

## CLASIFICACION: CORTO PLAZO INDIZADA O COBERTURA EN DOLARES

## COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES

DEL DIA 29/07/2022

CALIFICACION: AAAf/S5(mex)

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
<b>Inversión en Dólares</b>					
CHD	EFFECTIV			196,535,816.60	99.55%
				196,535,816.60	
				196,535,816.60	
<b>Reportos</b>					
IM	BPAG28	250508	mxAAA	895,836.52	0.45%
				895,836.52	
				895,836.52	
<b>CARTERA TOTAL:</b>				<b>197,431,653.12</b>	<b>100.00%</b>
<b>VaR ESTABLECIDO:</b>			<b>2.000 %</b>		
<b>VaR OBSERVADO PROMEDIO:</b>			<b>0.9779 %</b>		

**Valor en Riesgo (VaR)**

METODOLOGIA: Corresponde a estimar la pérdida que puede afrontar un portafolio por variaciones en los factores de riesgo, dado un nivel de confianza y un horizonte de tiempo.

PARAMETROS: Método Histórico ponderado exponencialmente, nivel de confianza del 95% y horizonte 1 día.

Esta información se actualiza el último día hábil de cada semana.