

## CLASIFICACION: CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL

## COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES

DEL DIA 28/06/2019

CALIFICACION: AAAf/S2(mex)

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
<b>Gubernamentales</b>					
IM	BPAG28	200514	mxAAA	40,151,447.20	0.37%
				40,151,447.20	
LD	BONDES	190808	mxAAA	401,649,824.00	3.75%
LD	BONDES	191003	mxAAA	200,818,138.00	1.87%
LD	BONDES	191205	mxAAA	1,102,701,919.00	10.31%
LD	BONDES	191226	mxAAA	652,624,576.50	6.10%
LD	BONDES	200402	mxAAA	180,118,051.20	1.68%
LD	BONDES	200528	mxAAA	450,233,352.00	4.21%
LD	BONDES	200730	mxAAA	91,546,335.43	0.85%
LD	BONDES	200924	mxAAA	402,066,460.00	3.76%
				3,481,758,656.13	
				3,521,910,103.33	
<b>Reportos</b>					
IM	BPAG28	210513	mxAAA	100,068,328.07	0.93%
				100,068,328.07	
IQ	BPAG91	220825	mxAAA	338,003,494.68	3.16%
				338,003,494.68	
LD	BONDES	220908	mxAAA	3,264,471,447.66	30.59%
LD	BONDES	231101	mxAAA	99,784,177.27	0.93%
LD	BONDES	231221	mxAAA	288,243,978.41	2.69%
LD	BONDES	240229	mxAAA	334,282,085.09	3.12%
LD	BONDES	240425	mxAAA	2,745,886,432.34	25.68%
				6,732,668,120.77	
				7,170,739,943.52	
<b>CARTERA TOTAL:</b>				<b>10,692,650,046.85</b>	<b>100.00%</b>

VaR ESTABLECIDO: 0.050 %

VaR OBSERVADO PROMEDIO: 0.0004 %

**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, nivel de confianza del 95% y horizonte 1 día.

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