

CLASIFICACION: CORTO PLAZO INDIZADA O COBERTURA EN DOLARES

COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES

DEL DIA 31/12/2021

CALIFICACION: AAAf/S5(mex)

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
Inversión en Dólares					
CHD	EFFECTIV			705,700,062.94	99.65%
				705,700,062.94	
				705,700,062.94	
Reportos					
IQ	BPAG91	260507	mxAAA	2,512,311.20	0.35%
				2,512,311.20	
				2,512,311.20	
CARTERA TOTAL:				708,212,374.14	100.00%
VaR ESTABLECIDO:			2.000 %		
VaR OBSERVADO PROMEDIO:			1.0408 %		

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.