

CLASIFICACION: CORTO PLAZO
COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES
DEL DIA 31/12/2021
CALIFICACION: AAAf/S1(mex)

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
Gubernamentales					
BI	CETES	220113	mxA-1+	549,163,285.00	12.79%
BI	CETES	220120	mxA-1+	329,146,917.00	7.66%
BI	CETES	220127	mxA-1+	328,794,411.00	7.65%
BI	CETES	220217	mxA-1+	297,929,130.00	6.93%
BI	CETES	220310	mxA-1+	98,961,320.00	2.30%
				1,603,995,063.00	
IM	BPAG28	240509	mxAAA	99,794,525.00	2.32%
				99,794,525.00	
LD	BONDESD	220113	mxAAA	100,272,705.00	2.33%
LD	BONDESD	220224	mxAAA	450,635,284.41	10.49%
LD	BONDESD	220317	mxAAA	100,155,832.00	2.33%
LD	BONDESD	220428	mxAAA	361,261,681.20	8.41%
LD	BONDESD	220519	mxAAA	250,093,322.50	5.82%
LD	BONDESD	220908	mxAAA	100,012,061.00	2.32%
LD	BONDESD	230504	mxAAA	100,135,336.00	2.33%
LD	BONDESD	240530	mxAAA	112,628,701.07	2.62%
				1,575,194,923.18	
LF	BONDESF	221103	mxAAA	300,007,053.00	6.98%
				300,007,053.00	
				3,578,991,564.18	
Reportos					
IQ	BPAG91	260507	mxAAA	150,067,422.17	3.49%
				150,067,422.17	
LD	BONDESD	250619	mxAAA	564,506,531.75	13.23%
				564,506,531.75	
				714,573,953.92	
CARTERA TOTAL:				4,293,565,518.10	100.00%

VaR ESTABLECIDO: 0.050 %

VaR OBSERVADO PROMEDIO: 0.0027 %

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.