

## CLASIFICACION: CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL

## COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES

DEL DIA 29/04/2022

CALIFICACION: AAAf/S2(mex)

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
<b>Gubernamentales</b>					
BI	CETES	220505	mxA-1+	160,488,602.36	1.31%
BI	CETES	220519	mxA-1+	996,884,600.00	8.32%
BI	CETES	220602	mxA-1+	497,067,400.00	4.08%
BI	CETES	220630	mxA-1+	494,138,500.00	4.05%
BI	CETES	220714	mxA-1+	492,737,550.00	4.04%
BI	CETES	220721	mxA-1+	492,026,050.00	4.04%
BI	CETES	220728	mxA-1+	800,611,340.04	6.57%
BI	CETES	230405	mxA-1+	92,396,900.00	0.75%
				<u>4,026,350,942.40</u>	
IM	BPAG28	240509	mxAAA	200,026,988.00	1.64%
				<u>200,026,988.00</u>	
LD	BONDESD	220519	mxAAA	100,197,606.00	0.82%
LD	BONDESD	220811	mxAAA	500,989,435.13	4.11%
LD	BONDESD	231005	mxAAA	600,149,934.00	4.92%
LD	BONDESD	240404	mxAAA	350,580,972.00	2.87%
LD	BONDESD	240530	mxAAA	283,652,107.85	2.32%
LD	BONDESD	250814	mxAAA	796,146,512.00	6.53%
				<u>2,631,716,566.98</u>	
LF	BONDESF	221006	mxAAA	499,873,819.96	4.10%
LF	BONDESF	221103	mxAAA	300,500,055.00	2.46%
LF	BONDESF	230105	mxAAA	700,194,537.00	5.74%
LF	BONDESF	230202	mxAAA	560,124,303.20	4.59%
LF	BONDESF	240104	mxAAA	599,063,250.00	4.91%
				<u>2,659,755,965.16</u>	
				<u>9,517,850,462.54</u>	
<b>Reportos</b>					
BI	CETES	220616	mxA-1+	900,494,998.02	7.39%
				<u>900,494,998.02</u>	

**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.

**CLASIFICACION: CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL**  
**COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES**  
**DEL DIA 29/04/2022**  
**CALIFICACION: AAAf/S2(mex)**

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
<b>Reportos</b>					
IM	BPAG28	241107	mxAAA	900,494,971.63	7.39%
				900,494,971.63	
IQ	BPAG91	250430	mxAAA	450,953,060.99	3.70%
				450,953,060.99	
LD	BONDESD	240425	mxAAA	408,835,252.64	3.35%
				408,835,252.64	
				2,660,778,283.28	
<b>CARTERA TOTAL:</b>				<b>12,178,628,745.82</b>	<b>100.00%</b>
<b>VaR ESTABLECIDO:</b>			<b>0.050 %</b>		
<b>VaR OBSERVADO PROMEDIO:</b>			<b>0.0032 %</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.