

**CLASIFICACION: LARGO PLAZO**  
**COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES**  
**DEL DIA 28/06/2019**  
**CALIFICACION: AAAf/S6(mex)**

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
<b>Gubernamentales</b>					
M	BONOS	210610	mxAAA	2,958,818.49	1.22%
M	BONOS	220609	mxAAA	98,065,194.00	40.52%
M	BONOS	231207	mxAAA	51,441,683.50	21.24%
M	BONOS	240905	mxAAA	21,035,191.20	8.68%
M	BONOS	241205	mxAAA	43,832,606.22	18.10%
M	BONOS	260305	mxAAA	2,791,892.97	1.15%
M	BONOS	270603	mxAAA	10,055,002.90	4.15%
				230,180,389.28	
				230,180,389.28	
<b>Reportos</b>					
IQ	BPAG91	240111	mxAAA	11,980,987.18	4.94%
				11,980,987.18	
				11,980,987.18	
<b>CARTERA TOTAL:</b>				<b>242,161,376.46</b>	<b>100.00%</b>
<b>VaR ESTABLECIDO:</b>			<b>1.700 %</b>		
<b>VaR OBSERVADO PROMEDIO:</b>			<b>0.2928 %</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, nivel de confianza del 95% y horizonte 1 día.

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