

**INVEXMP**  
**CLASIFICACION: MEDIANO PLAZO**  
**COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES**  
**DEL DIA 28/06/2019**  
**CALIFICACION: AAAf/S4(mex)**

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
<b>Gubernamentales</b>					
IQ	BPAG91	190822	mxAAA	40,354,822.00	3.59%
IQ	BPAG91	201224	mxAAA	80,011,921.60	7.13%
IQ	BPAG91	220825	mxAAA	40,182,968.40	3.58%
				160,549,712.00	
IS	BPA182	190704	mxAAA	65,241,092.04	5.81%
				65,241,092.04	
LD	BONDESD	210325	mxAAA	70,107,547.30	6.25%
LD	BONDESD	210819	mxAAA	99,949,677.00	8.91%
LD	BONDESD	220113	mxAAA	50,196,141.00	4.47%
				220,253,365.30	
				446,044,169.34	
<b>Papel Privado</b>					
91	ACBE	17-2	mxAAA	60,162,351.60	5.36%
91	BACHOCO	17	AAA(mex)	11,150,892.55	0.99%
91	GMXT	17-2	mxAAA	60,295,609.80	5.37%
91	LIVEPOL	17-2	mxAAA	59,970,693.60	5.34%
				191,579,547.55	
94	BANORTE	19	mxAAA	50,255,341.00	4.48%
				50,255,341.00	
				241,834,888.55	
<b>Reportos</b>					
LD	BONDESD	230831	mxAAA	133,552,272.60	11.90%
LD	BONDESD	240425	mxAAA	300,206,247.25	26.82%
				433,758,519.85	
				433,758,519.85	
<b>CARTERA TOTAL:</b>				<b>1,121,637,577.74</b>	<b>100.00%</b>
<b>VaR ESTABLECIDO:</b>			<b>0.060 %</b>		
<b>VaR OBSERVADO PROMEDIO:</b>			<b>0.0019 %</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.