

CLASIFICACION: CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL

COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES

DEL DIA 26/02/2021

CALIFICACION: AAAf/S2(mex)

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
Gubernamentales					
BI	CETES	210701	mxA-2	302,583,072.01	2.85%
BI	CETES	220113	mxA-2	578,733,480.00	5.45%
				881,316,552.01	
LD	BONDES	210325	mxAAA	625,254,587.50	5.89%
LD	BONDES	210520	mxAAA	100,029,801.00	0.94%
LD	BONDES	210722	mxAAA	521,317,227.60	4.91%
LD	BONDES	210819	mxAAA	501,213,745.00	4.72%
LD	BONDES	220113	mxAAA	300,340,449.00	2.83%
LD	BONDES	220203	mxAAA	350,664,713.00	3.30%
LD	BONDES	220317	mxAAA	800,108,184.00	7.54%
LD	BONDES	231005	mxAAA	597,820,290.00	5.63%
LD	BONDES	250814	mxAAA	795,953,392.00	7.50%
				4,592,702,389.10	
				5,474,018,941.11	
Reportos					
IM	BPAG28	210812	mxAAA	571,339,128.59	5.38%
				571,339,128.59	
IQ	BPAG91	210826	mxAAA	432,616,770.24	4.07%
IQ	BPAG91	211223	mxAAA	351,778,234.30	3.31%
IQ	BPAG91	250102	mxAAA	857,705,972.63	8.08%
				1,642,100,977.17	
LD	BONDES	210819	mxAAA	869,170,307.00	8.19%
LD	BONDES	240425	mxAAA	2,050,684,953.02	19.41%
				2,919,855,260.02	
				5,133,295,365.78	
CARTERA TOTAL:				10,607,314,306.89	100.00%

VaR ESTABLECIDO: 0.050 %

VaR OBSERVADO PROMEDIO: 0.0023 %

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.