

## CLASIFICACION: CORTO PLAZO DE COBERTURA CAMBIARIA

## COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES

DEL DIA 28/06/2019

CALIFICACION: AAAf/S5(mex)

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
<b>Inversión en Dólares</b>					
CHD	EFFECTIV			4,140,129,792.51	99.74%
				4,140,129,792.51	
				4,140,129,792.51	
<b>Reportos</b>					
IQ	BPAG91	240111	mxAAA	11,169,294.68	0.26%
				11,169,294.68	
				11,169,294.68	
<b>CARTERA TOTAL:</b>				<b>4,151,299,087.19</b>	<b>100.00%</b>
<b>VaR ESTABLECIDO:</b>			<b>2.000 %</b>		
<b>VaR OBSERVADO PROMEDIO:</b>			<b>0.9775 %</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.