

INVEXCP
CLASIFICACION: CORTO PLAZO
COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES
DEL DIA 28/06/2019
CALIFICACION: AAAf/S2(mex)

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
Gubernamentales					
LD	BONDESD	191205	mxAAA	290,712,324.10	11.25%
LD	BONDESD	191226	mxAAA	200,807,562.00	7.77%
LD	BONDESD	200730	mxAAA	160,838,635.20	6.22%
				652,358,521.30	
				652,358,521.30	
Bancarios					
I	BACMEXT	19264	mxA-1+	271,578,852.16	10.51%
I	BACMEXT	19274	mxA-1+	251,058,456.39	9.72%
I	BACMEXT	19284	mxA-1+	230,589,296.58	8.92%
I	BACMEXT	19294	mxA-1+	250,230,132.66	9.68%
				1,003,456,737.79	
				1,003,456,737.79	
Reportos					
IQ	BPAG91	220825	mxAAA	400,274,969.07	15.49%
				400,274,969.07	
LD	BONDESD	230831	mxAAA	126,257,859.76	4.88%
LD	BONDESD	240425	mxAAA	400,274,963.15	15.56%
				526,532,822.91	
				926,807,791.98	
CARTERA TOTAL:				2,582,623,051.07	100.00%
VaR ESTABLECIDO:			0.050 %		
VaR OBSERVADO PROMEDIO:			0.0016 %		

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.