

CLASIFICACION: CORTO PLAZO INDIZADA O COBERTURA DOLARES

COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES

DEL DIA 04/03/2021

CALIFICACION: AAAf/S5(mex)

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
Inversión en Dólares					
CHD	EFFECTIV			1,248,298,395.26	99.74%
				1,248,298,395.26	
				1,248,298,395.26	
Reportos					
LD	BONDESD	240425	mxAAA	3,370,743.29	0.26%
				3,370,743.29	
				3,370,743.29	
CARTERA TOTAL:				1,251,669,138.55	100.00%
VaR ESTABLECIDO:			2.000 %		
VaR OBSERVADO PROMEDIO:			1.2950 %		

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.