

## CLASIFICACION: LARGO PLAZO GUBERNAMENTAL

## COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES

DEL DIA 31/12/2021

CALIFICACION: AAAf/S5(mex)

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
<b>Gubernamentales</b>					
LD	BONDES	250619	mxAAA	22,949,632.99	15.05%
LD	BONDES	250814	mxAAA	19,951,300.00	13.08%
				42,900,932.99	
M	BONOS	241205	mxAAA	43,139,110.00	28.32%
M	BONOS	260305	mxAAA	24,037,336.00	15.76%
M	BONOS	270603	mxAAA	10,087,223.80	6.61%
M	BONOS	310529	mxAAA	10,173,993.70	6.67%
				87,437,663.50	
S	UDIBONO	231116	mxAAA	10,921,151.57	7.16%
				10,921,151.57	
				141,259,748.06	
<b>Reportos</b>					
IQ	BPAG91	260507	mxAAA	11,210,050.67	7.35%
				11,210,050.67	
				11,210,050.67	
<b>CARTERA TOTAL:</b>				<b>152,469,798.73</b>	<b>100.00%</b>
<b>VaR ESTABLECIDO:</b>			<b>1.700 %</b>		
<b>VaR OBSERVADO PROMEDIO:</b>			<b>0.2676 %</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 ponderado exponencialmente, nivel de confianza del 95% y horizonte 1 día.

Esta información se actualiza el último día hábil de cada semana.