

**CLASIFICACION: MEDIANO PLAZO**  
**COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES**  
**DEL DIA 12/09/2019**  
**CALIFICACION: AAAf/S4(mex)**

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
<b>Gubernamentales</b>					
IQ	BPAG91	200423	mxAAA	50,581,073.00	4.38%
IQ	BPAG91	200820	mxAAA	50,232,584.50	4.35%
IQ	BPAG91	201224	mxAAA	81,414,466.40	7.06%
IQ	BPAG91	220825	mxAAA	40,034,033.20	3.47%
				222,262,157.10	
LD	BONDESD	210325	mxAAA	69,957,551.30	6.07%
LD	BONDESD	210819	mxAAA	100,365,620.00	8.70%
LD	BONDESD	220113	mxAAA	50,081,859.50	4.34%
				220,405,030.80	
				442,667,187.90	
<b>Papel Privado</b>					
91	ACBE	17-2	mxAAA	60,418,727.40	5.24%
91	BACHOCO	17	AAA(mex)	11,198,230.07	0.97%
91	GMXT	17-2	mxAAA	60,148,498.80	5.21%
91	LIVEPOL	17-2	mxAAA	64,515,968.36	5.59%
				196,281,424.63	
94	BANORTE	19	mxAAA	50,178,699.00	4.35%
				50,178,699.00	
				246,460,123.63	
<b>Reportos</b>					
IQ	BPAG91	220825	mxAAA	363,221,400.13	31.60%
				363,221,400.13	
LD	BONDESD	231221	mxAAA	100,022,261.09	8.67%
				100,022,261.09	
				463,243,661.22	
<b>CARTERA TOTAL:</b>				<b>1,152,370,972.75</b>	<b>100.00%</b>
<b>VaR ESTABLECIDO:</b>			<b>0.060 %</b>		
<b>VaR OBSERVADO PROMEDIO:</b>			<b>0.0021 %</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.