

**CLASIFICACION: CORTO PLAZO**  
**COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES**  
**DEL DIA 27/01/2022**  
**CALIFICACION: AAAf/S1(mex)**

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
<b>Gubernamentales</b>					
BI	CETES	220210	mxA-1+	548,909,515.00	13.38%
BI	CETES	220217	mxA-1+	628,104,204.00	15.37%
BI	CETES	220310	mxA-1+	99,334,310.00	2.42%
				1,276,348,029.00	
IM	BPAG28	240509	mxAAA	99,774,900.00	2.43%
				99,774,900.00	
LD	BONDES	220224	mxAAA	450,453,497.34	10.98%
LD	BONDES	220317	mxAAA	100,116,144.00	2.44%
LD	BONDES	220428	mxAAA	361,168,236.00	8.80%
LD	BONDES	220519	mxAAA	249,996,910.00	6.09%
LD	BONDES	220908	mxAAA	99,975,711.00	2.43%
LD	BONDES	230504	mxAAA	100,104,295.00	2.44%
LD	BONDES	240530	mxAAA	112,591,608.72	2.74%
				1,474,406,402.06	
LF	BONDES	221103	mxAAA	299,896,485.00	7.31%
LF	BONDES	240104	mxAAA	100,075,176.00	2.43%
				399,971,661.00	
				3,250,500,992.06	
<b>Reportos</b>					
IM	BPAG28	231109	mxAAA	200,030,234.99	4.87%
				200,030,234.99	
LD	BONDES	240229	mxAAA	251,423,747.75	6.12%
LD	BONDES	240627	mxAAA	400,060,810.51	9.75%
				651,484,558.26	
				851,514,793.25	
<b>CARTERA TOTAL:</b>				<b>4,102,015,785.31</b>	<b>100.00%</b>

**VaR ESTABLECIDO:** 0.050 %

**VaR OBSERVADO PROMEDIO:** 0.0020 %

**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.