

CLASIFICACION: CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL

COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES

DEL DIA 04/03/2021

CALIFICACION: AAAf/S2(mex)

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
Gubernamentales					
BI	CETES	210701	mxA-2	302,718,017.75	3.27%
BI	CETES	220113	mxA-2	578,895,900.00	6.25%
				881,613,917.75	
LD	BONDES	210325	mxAAA	625,539,250.00	6.75%
LD	BONDES	210520	mxAAA	100,075,684.00	1.08%
LD	BONDES	210722	mxAAA	519,898,579.20	5.61%
LD	BONDES	210819	mxAAA	499,847,750.00	5.40%
LD	BONDES	220113	mxAAA	300,477,348.00	3.24%
LD	BONDES	220203	mxAAA	349,708,786.00	3.77%
LD	BONDES	220317	mxAAA	800,509,896.00	8.64%
LD	BONDES	231005	mxAAA	598,098,624.00	6.46%
LD	BONDES	250814	mxAAA	793,828,648.00	8.57%
				4,587,984,565.20	
				5,469,598,482.95	
Reportos					
IQ	BPAG91	210826	mxAAA	477,364,427.56	5.15%
IQ	BPAG91	240829	mxAAA	397,572,483.54	4.29%
IQ	BPAG91	251231	mxAAA	349,482,803.92	3.77%
				1,224,419,715.02	
IS	BPA182	250306	mxAAA	102,697,584.91	1.10%
				102,697,584.91	
LD	BONDES	230504	mxAAA	166,089,835.51	1.79%
LD	BONDES	240425	mxAAA	2,292,517,864.00	24.86%
				2,458,607,699.51	
				3,785,724,999.44	
CARTERA TOTAL:				9,255,323,482.39	100.00%

VaR ESTABLECIDO: 0.050 %

VaR OBSERVADO PROMEDIO: 0.0033 %

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.