

INVEXDX
CLASIFICACION: CORTO PLAZO
COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES
DEL DIA 26/02/2021
CALIFICACION: AAAf/S2(mex)

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
Gubernamentales					
LD	BONDES	210520	mxAAA	30,008,940.30	6.75%
LD	BONDES	220113	mxAAA	30,034,044.90	6.76%
LD	BONDES	220317	mxAAA	30,004,056.90	6.75%
LD	BONDES	231005	mxAAA	49,818,357.50	11.22%
LD	BONDES	250814	mxAAA	29,848,252.20	6.72%
				169,713,651.80	
				169,713,651.80	
Bancarios					
I	BACMEX	21094	mxA-1+	60,173,847.58	13.55%
I	BACMEX	21104	mxA-1+	40,081,659.45	9.02%
I	BACMEX	21114	mxA-1+	50,060,994.05	11.27%
				150,316,501.08	
				150,316,501.08	
Reportos					
IQ	BPAG91	211223	mxAAA	93,930,244.82	21.21%
				93,930,244.82	
LD	BONDES	240425	mxAAA	30,010,001.77	6.75%
				30,010,001.77	
				123,940,246.59	
CARTERA TOTAL:				443,970,399.47	100.00%
VaR ESTABLECIDO:			0.050 %		
VaR OBSERVADO PROMEDIO:			0.0023 %		

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.