

**CLASIFICACION: CORTO PLAZO**  
**COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES**  
**DEL DIA 29/07/2022**  
**CALIFICACION: AAAf/S2(mex)**

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
<b>Gubernamentales</b>					
BI	CETES	220804	mxA-1+	9,993,508.00	3.38%
BI	CETES	220818	mxA-1+	9,963,496.00	3.37%
BI	CETES	220825	mxA-1+	24,867,527.50	8.42%
BI	CETES	220901	mxA-1+	19,859,126.00	6.72%
BI	CETES	221013	mxA-1+	29,488,026.00	9.99%
BI	CETES	230601	mxA-1+	37,075,160.00	12.56%
				<u>131,246,843.50</u>	
IM	BPAG28	240509	mxAAA	20,050,199.80	6.79%
				<u>20,050,199.80</u>	
LD	BONDESD	231005	mxAAA	20,054,550.20	6.79%
LD	BONDESD	250814	mxAAA	29,919,876.00	10.13%
				<u>49,974,426.20</u>	
LF	BONDESF	230202	mxAAA	40,082,896.80	13.65%
LF	BONDESF	230525	mxAAA	20,037,754.00	6.79%
				<u>60,120,650.80</u>	
				<u>261,392,120.30</u>	
<b>Reportos</b>					
BI	CETES	220915	mxA-1+	14,009,126.42	4.74%
				<u>14,009,126.42</u>	
IQ	BPAG91	260903	mxAAA	19,704,633.58	6.67%
				<u>19,704,633.58</u>	
				<u>33,713,760.00</u>	
<b>CARTERA TOTAL:</b>				<b>295,105,880.30</b>	<b>100.00%</b>
<b>VaR ESTABLECIDO:</b>			<b>0.050 %</b>		
<b>VaR OBSERVADO PROMEDIO:</b>			<b>0.0157 %</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.