

## CLASIFICACION: LARGO PLAZO GUBERNAMENTAL

## COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES

DEL DIA 18/02/2021

CALIFICACION: AAAf/S6(mex)

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
<b>Gubernamentales</b>					
LD	BONDES	231005	mxAAA	19,968,862.00	3.46%
LD	BONDES	250814	mxAAA	19,874,867.60	3.44%
				39,843,729.60	
M	BONOS	220609	mxAAA	88,798,098.35	15.39%
M	BONOS	231207	mxAAA	39,011,258.30	6.76%
M	BONOS	240905	mxAAA	45,995,783.60	7.97%
M	BONOS	241205	mxAAA	108,774,361.80	18.91%
M	BONOS	260305	mxAAA	106,411,540.00	18.44%
M	BONOS	270603	mxAAA	11,384,381.80	1.97%
				400,375,423.85	
S	UDIBONO	231116	mxAAA	21,811,303.20	3.78%
S	UDIBONO	251204	mxAAA	20,582,351.08	3.56%
S	UDIBONO	281130	mxAAA	31,100,023.72	5.39%
S	UDIBONO	351122	mxAAA	20,313,019.32	3.52%
				93,806,697.32	
				534,025,850.77	
<b>Reportos</b>					
IM	BPAG28	230209	mxAAA	42,770,831.44	7.41%
				42,770,831.44	
				42,770,831.44	
<b>CARTERA TOTAL:</b>				<b>576,796,682.21</b>	<b>100.00%</b>
<b>VaR ESTABLECIDO:</b>			<b>1.700 %</b>		
<b>VaR OBSERVADO PROMEDIO:</b>			<b>0.1442 %</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.