

CLASIFICACION: LARGO PLAZO GUBERNAMENTAL

COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES

DEL DIA 11/08/2022

CALIFICACION: AAAf/S5(mex)

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
Gubernamentales					
LD	BONDESD	250619	mxAAA	4,999,857.30	4.95%
				4,999,857.30	
M	BONOS	241205	mxAAA	19,736,840.33	19.54%
M	BONOS	260305	mxAAA	26,207,925.80	26.00%
M	BONOS	270304	mxAAA	23,631,771.80	23.40%
M	BONOS	310529	mxAAA	14,514,676.20	14.37%
				84,091,214.13	
S	UDIBONO	261203	mxAAA	6,121,674.65	6.06%
				6,121,674.65	
				95,212,746.08	
Reportos					
BI	CETES	230504	mxA-1+	3,500,758.51	3.46%
				3,500,758.51	
IQ	BPAG91	260507	mxAAA	2,247,432.12	2.22%
				2,247,432.12	
				5,748,190.63	
CARTERA TOTAL:				100,960,936.71	100.00%
VaR ESTABLECIDO:			1.700 %		
VaR OBSERVADO PROMEDIO:			0.3900 %		

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.