

CLASIFICACION: LARGO PLAZO GUBERNAMENTAL

COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES

DEL DIA 29/07/2022

CALIFICACION: AAAf/S5(mex)

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
Gubernamentales					
LD	BONDESD	250619	mxAAA	10,015,115.96	9.01%
				10,015,115.96	
M	BONOS	241205	mxAAA	25,886,376.25	23.31%
M	BONOS	260305	mxAAA	26,143,351.36	23.58%
M	BONOS	270304	mxAAA	23,512,158.54	21.17%
M	BONOS	310529	mxAAA	14,441,904.30	13.00%
				89,983,790.45	
S	UDIBONO	261203	mxAAA	6,068,450.33	5.46%
				6,068,450.33	
				106,067,356.74	
Reportos					
BI	CETES	220915	mxA-1+	4,002,604.73	3.60%
				4,002,604.73	
IM	BPAG28	241107	mxAAA	970,311.28	0.87%
				970,311.28	
				4,972,916.01	
CARTERA TOTAL:				111,040,272.75	100.00%
VaR ESTABLECIDO:			1.700 %		
VaR OBSERVADO PROMEDIO:			0.3910 %		

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.