

CLASIFICACION: LARGO PLAZO GUBERNAMENTAL

COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES

DEL DIA 26/02/2021

CALIFICACION: AAAf/S6(mex)

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
Gubernamentales					
LD	BONDES	231005	mxAAA	19,927,343.00	3.38%
LD	BONDES	250814	mxAAA	19,898,834.80	3.37%
				39,826,177.80	
M	BONOS	220609	mxAAA	88,743,229.15	15.06%
M	BONOS	231207	mxAAA	38,931,748.45	6.60%
M	BONOS	240905	mxAAA	45,779,428.40	7.77%
M	BONOS	241205	mxAAA	108,141,688.80	18.44%
M	BONOS	260305	mxAAA	105,474,533.00	17.90%
M	BONOS	270603	mxAAA	11,219,764.50	1.90%
M	BONOS	310529	mxAAA	11,319,804.80	1.92%
				409,610,197.10	
S	UDIBONO	231116	mxAAA	21,609,476.46	3.66%
S	UDIBONO	251204	mxAAA	20,357,141.30	3.45%
S	UDIBONO	281130	mxAAA	30,442,649.90	5.16%
S	UDIBONO	351122	mxAAA	19,662,085.13	3.33%
				92,071,352.79	
				541,507,727.69	
Reportos					
IQ	BPAG91	211223	mxAAA	47,518,551.00	8.06%
				47,518,551.00	
				47,518,551.00	
CARTERA TOTAL:				589,026,278.69	100.00%
VaR ESTABLECIDO:			1.700 %		
VaR OBSERVADO PROMEDIO:			0.1743 %		

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.