

## CLASIFICACION: LARGO PLAZO GUBERNAMENTAL

## COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES

DEL DIA 27/01/2022

CALIFICACION: AAAf/S5(mex)

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
<b>Gubernamentales</b>					
LD	BONDES	250619	mxAAA	14,854,860.20	10.04%
LD	BONDES	250814	mxAAA	14,840,629.01	10.03%
				29,695,489.21	
M	BONOS	241205	mxAAA	43,037,611.20	29.11%
M	BONOS	260305	mxAAA	35,428,186.35	23.94%
M	BONOS	270603	mxAAA	10,054,548.40	6.79%
M	BONOS	310529	mxAAA	10,136,066.40	6.85%
				98,656,412.35	
S	UDIBONO	231116	mxAAA	10,789,920.18	7.29%
				10,789,920.18	
				139,141,821.74	
<b>Reportos</b>					
IQ	BPAG91	260903	mxAAA	8,811,105.10	5.95%
				8,811,105.10	
				8,811,105.10	
<b>CARTERA TOTAL:</b>				<b>147,952,926.84</b>	<b>100.00%</b>
<b>VaR ESTABLECIDO:</b>			<b>1.700 %</b>		
<b>VaR OBSERVADO PROMEDIO:</b>			<b>0.2750 %</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.