

CLASIFICACION: LARGO PLAZO GUBERNAMENTAL
COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES
DEL DIA 31/05/2024
CALIFICACION: AAAf/S5(mex)

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
Gubernamentales					
LF	BONDESF	290125	mxAAA	26,902,107.72	7.48%
				<u>26,902,107.72</u>	
M	BONOS	270603	mxAAA	166,512,399.90	46.36%
M	BONOS	290301	mxAAA	62,834,147.35	17.48%
M	BONOS	290531	mxAAA	19,773,407.20	5.50%
M	BONOS	310529	mxAAA	32,703,134.10	9.09%
M	BONOS	330526	mxAAA	19,853,009.88	5.52%
M	BONOS	341123	mxAAA	15,436,203.66	4.29%
				<u>317,112,302.09</u>	
				<u>344,014,409.81</u>	
Reportos					
IS	BPA182	250306	mxAAA	15,398,950.90	4.28%
				<u>15,398,950.90</u>	
				<u>15,398,950.90</u>	
CARTERA TOTAL:				359,413,360.71	100.00%
VaR ESTABLECIDO:			1.700 %		
VaR OBSERVADO PROMEDIO:			0.4324 %		

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.