

CLASIFICACION: CORTO PLAZO
COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES
DEL DIA 18/07/2024
CALIFICACION: AAAf/S1(mex)

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
Gubernamentales					
BI	CETES	240725	mxA-1+	598,888,560.00	10.20%
				598,888,560.00	
IQ	BPAG91	250102	mxAAA	180,753,948.00	3.08%
				180,753,948.00	
LF	BONDESF	240815	mxAAA	200,049,862.00	3.40%
LF	BONDESF	241024	mxAAA	100,438,905.00	1.71%
LF	BONDESF	241107	mxAAA	300,023,190.00	5.11%
LF	BONDESF	250116	mxAAA	702,959,789.00	12.05%
LF	BONDESF	250327	mxAAA	699,869,639.00	11.92%
LF	BONDESF	250403	mxAAA	553,399,726.00	9.43%
LF	BONDESF	250703	mxAAA	401,501,840.00	6.84%
LF	BONDESF	251009	mxAAA	249,756,160.00	4.25%
LF	BONDESF	260423	mxAAA	74,865,570.00	1.27%
LF	BONDESF	260604	mxAAA	501,107,930.00	8.54%
LF	BONDESF	270114	mxAAA	100,081,426.00	1.70%
LF	BONDESF	270520	mxAAA	447,907,482.00	7.63%
				4,331,961,519.00	
				5,111,604,027.00	

Reportos

IQ	BPAG91	250102	mxAAA	305,669,840.54	5.20%
				305,669,840.54	
LF	BONDESF	270930	mxAAA	450,137,561.43	7.67%
				450,137,561.43	
				755,807,401.97	

CARTERA TOTAL:**5,867,411,428.97 100.00%****VaR ESTABLECIDO:****0.050 %****VaR OBSERVADO PROMEDIO:****0.0018 %****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.