

## CLASIFICACION: LARGO PLAZO GUBERNAMENTAL

## COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES

DEL DIA 18/07/2024

CALIFICACION: AAAf/S5(mex)

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
<b>Gubernamentales</b>					
LF	BONDESF	290125	mxAAA	26,818,637.76	8.03%
				26,818,637.76	
M	BONOS	290301	mxAAA	133,965,991.50	40.19%
M	BONOS	290531	mxAAA	104,911,807.00	31.44%
M	BONOS	310529	mxAAA	31,606,021.65	9.47%
M	BONOS	330526	mxAAA	19,105,841.70	5.72%
M	BONOS	341123	mxAAA	14,801,752.44	4.43%
				304,391,414.29	
				331,210,052.05	
<b>Reportos</b>					
IQ	BPAG91	250102	mxAAA	2,430,886.29	0.72%
				2,430,886.29	
				2,430,886.29	
<b>CARTERA TOTAL:</b>				<b>333,640,938.34</b>	<b>100.00%</b>
<b>VaR ESTABLECIDO:</b>			<b>1.700 %</b>		
<b>VaR OBSERVADO PROMEDIO:</b>			<b>0.5791 %</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.