

CLASIFICACION: CORTO PLAZO
COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES
DEL DIA 29/11/2024
CALIFICACION: AAAf/S1(mex)

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
Gubernamentales					
BI	CETES	241205	mxA-1+	249,781,850.00	3.53%
				249,781,850.00	
IQ	BPAG91	250102	mxAAA	183,186,399.60	2.59%
				183,186,399.60	
LF	BONDESF	250116	mxAAA	702,144,387.00	9.94%
LF	BONDESF	250327	mxAAA	704,894,624.00	9.98%
LF	BONDESF	250403	mxAAA	552,695,753.50	7.82%
LF	BONDESF	250703	mxAAA	865,699,215.81	12.26%
LF	BONDESF	251009	mxAAA	251,618,677.50	3.56%
LF	BONDESF	260423	mxAAA	75,418,997.25	1.06%
LF	BONDESF	260604	mxAAA	500,649,805.00	7.09%
LF	BONDESF	270114	mxAAA	99,982,324.00	1.41%
LF	BONDESF	270520	mxAAA	451,339,942.50	6.39%
				4,204,443,726.56	
				4,637,411,976.16	
Inversión en Divisas					
CHD	EFFECTIV			2,423,527,048.21	34.37%
				2,423,527,048.21	
				2,423,527,048.21	
CARTERA TOTAL:				7,060,939,024.37	100.00%
VaR ESTABLECIDO:			0.050 %		
VaR OBSERVADO PROMEDIO:			0.0007 %		

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.