

CLASIFICACION: LARGO PLAZO GUBERNAMENTAL

COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES

DEL DIA 29/11/2024

CALIFICACION: AAAf/S5(mex)

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
Gubernamentales					
M	BONOS	290301	mxAAA	391,216,866.88	33.68%
M	BONOS	290531	mxAAA	574,658,070.50	49.49%
M	BONOS	341123	mxAAA	133,994,343.57	11.53%
				<u>1,099,869,280.95</u>	
				<u>1,099,869,280.95</u>	
Inversión en Divisas					
CHD	EFFECTIV			61,615,259.12	5.30%
				<u>61,615,259.12</u>	
				<u>61,615,259.12</u>	
CARTERA TOTAL:				1,161,484,540.07	100.00%
VaR ESTABLECIDO:			1.700 %		
VaR OBSERVADO PROMEDIO:			0.5064 %		

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.