

CLASIFICACION: LARGO PLAZO GUBERNAMENTAL

COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES

DEL DIA 13/02/2025

CALIFICACION: AAAf/S5(mex)

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
Gubernamentales					
M	BONOS	290301	mxAAA	279,461,905.20	29.86%
M	BONOS	290531	mxAAA	495,020,427.42	52.94%
M	BONOS	341123	mxAAA	37,224,867.66	3.97%
				811,707,200.28	
S	UDIBONO	261203	mxAAA	99,922,035.15	10.67%
				99,922,035.15	
				911,629,235.43	
Inversión en Divisas					
CHD	EFFECTIV			24,029,685.68	2.56%
				24,029,685.68	
				24,029,685.68	
CARTERA TOTAL:				935,658,921.11	100.00%
VaR ESTABLECIDO:			1.700 %		
VaR OBSERVADO PROMEDIO:			0.3691 %		

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 utilizando 251 días de historia o escenarios, horizonte temporal de un día y 95% de confianza.

Esta información se actualiza el último día hábil de cada semana.