

DINBUR2

mxAAAf/mxS1

VAR histórico con 500 escenarios a 1 día con un nivel de confianza del 95%

CORTO PLAZO

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
Cert. Bursatiles Bancarios					
94	BINBUR	24	NO APLICA	25,118,766	1.900%
				25,118,766	1.900%
Certificado Bursatil					
91	CIE	24	NO APLICA	158,067,787	11.958%
91	GCARSO	23	NO APLICA	75,184,158	5.688%
91	NM	24	mxAA+	50,225,223	3.799%
91	GCARSO	24	mxAAA	10,037,675	0.759%
91	MFRISCO	24	mxAAA	10,003,882	0.757%
91	MFRISCO	24-2	NO APLICA	5,050,569	0.382%
91	MFRISCO	24-3	NO APLICA	5,044,770	0.382%
91	MFRISCO	24	NO APLICA	2,521,511	0.191%
Certificado Bursatil Descuento					
92	CFE	04125	mxA-1+	14,709,913	1.113%
				14,709,913	1.113%
Cetes					
BI	CETES	250724	AAA(mex)	177,278,667	13.411%
BI	CETES	251224	AAA(mex)	129,223,692	9.776%
				48,054,975	3.635%
Pag. Med. Pzo. a Descuento					
93	GCARSO	00225	F1+(mex)	205,901,379	15.576%
93	GCARSO	00325	mxBBB+	80,670,085	6.103%
93	MFRISCO	00125	mxA-1+	60,253,834	4.558%
93	AMX	02825	mxA-1+	50,317,038	3.806%
				14,660,423	1.109%
Pagare con R. L. V.					
I	BANOBRA	25255	mxAAA	655,952,890	49.622%
I	BANOBRA	26052	mxAAA	469,111,779	35.488%
I	BANOBRA	26092	mxAAA	50,231,431	3.800%
I	BANOBRA	25525	mxAAA	50,225,721	3.800%
I	BANOBRA	25265	mxAAA	45,215,833	3.421%
				41,168,126	3.114%
Reportos					
LF	BONDESF	261231	AAA(mex)	84,869,199	6.420%
				84,869,199	6.420%
TOTAL CARTERA				1,321,898,601	100.000%
ACTIVO NETO				1,321,165,204	
VAR ESTABLECIDO \$				1,321,165	0.100%
VAR OBSERVADO PROMEDIO \$				157,360	0.012%
Cartera al:				26-jun-25	