

DINBUR1

AAA/2 SP

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

CORTO PLAZO

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF / BURS	VALOR TOTAL	%
	Certificado Bursatil			220,811,741	4.103%
91	MFRISCO	18	A-(mex)	220,811,741	4.103%
	Cetes			3,401,288,825	63.196%
BI	CETES	221006	AAA(mex)	737,966,175	13.712%
BI	CETES	220825	AAA(mex)	496,998,050	9.234%
BI	CETES	220922	AAA(mex)	493,650,800	9.172%
BI	CETES	230601	AAA(mex)	462,927,800	8.601%
BI	CETES	230112	AAA(mex)	431,622,945	8.020%
BI	CETES	221020	AAA(mex)	294,169,230	5.466%
BI	CETES	220811	AAA(mex)	249,309,800	4.632%
BI	CETES	230405	AAA(mex)	234,644,025	4.360%
	Pagare con R. L. V.			1,506,030,373	27.982%
I	BANOBRA	22382	mxA-1+	512,479,596	9.522%
I	BANOBRA	22341	mxA-1+	304,129,945	5.651%
I	BANOBRA	22305	mxA-1+	165,035,979	3.066%
I	BANOBRA	22463	mxA-1+	152,063,066	2.825%
I	BANOBRA	22333	mxA-1+	150,322,713	2.793%
I	BANOBRA	23071	mxA-1+	101,173,173	1.880%
I	BANOBRA	22391	mxA-1+	70,486,682	1.310%
I	BANOBRA	22521	mxA-1+	50,339,219	0.935%
	Reportos			253,957,107	4.719%
LD	BONDESD	251016	AAA(mex)	158,034,016	2.936%
LD	BONDESD	240822	AAA(mex)	95,923,091	1.782%
	TOTAL CARTERA			5,382,088,046	100.000%
	ACTIVO NETO			5,377,421,038	
	VAR ESTABLECIDO \$			4,301,937	0.080%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			741,586	0.014%
	Cartera al:		28-jul-22		