

DINBUR1

mxAAAf/mxS1

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			492,401,821	9.164%
91	MFRISCO	22	NO APLICA	206,870,354	3.850%
91	GCARSO	23	NO APLICA	200,144,222	3.725%
91	AMX	23-3	mxAAA	50,143,925	0.933%
91	FORTALE	23	NO APLICA	25,160,043	0.468%
91	NM	24	mxAA+	10,083,277	0.188%
	Cetes			1,511,583,195	28.132%
BI	CETES	240725	AAA(mex)	601,869,340	11.201%
BI	CETES	240627	AAA(mex)	244,775,975	4.556%
BI	CETES	240530	AAA(mex)	197,519,900	3.676%
BI	CETES	241017	AAA(mex)	141,976,590	2.642%
BI	CETES	240502	AAA(mex)	99,603,990	1.854%
BI	CETES	240613	AAA(mex)	98,327,280	1.830%
BI	CETES	240808	AAA(mex)	72,498,615	1.349%
BI	CETES	240516	AAA(mex)	55,011,505	1.024%
	Nota Estructurada sin Garantia			29,339,285	0.546%
JE	AMX	0129	mxAAA	29,339,285	0.546%
	Pag. Med. Pzo. a Descuento			759,984,294	14.144%
93	GCARSO	00324	mxAAA	300,380,913	5.590%
93	GCARSO	00224	F1+(mex)	200,253,942	3.727%
93	MFRISCO	00223	NO APLICA	102,276,944	1.903%
93	MFRISCO	00323	mxA-1+	50,800,495	0.945%
93	GCARSO	00424	F1+(mex)	50,063,486	0.932%
93	AMX	01924	mxA-1+	24,730,818	0.460%
93	AMX	01824	mxA-1+	19,963,589	0.372%
93	AMX	00724	mxA-1	6,654,563	0.124%
93	AMX	02324	mxA-1+	4,859,545	0.090%
	Pagare con R. L. V.			2,479,287,863	46.142%
I	BANOBRA	24165	mxA-1+	1,611,496,727	29.991%
I	BANOBRA	24321	mxA-1+	306,826,528	5.710%
I	BANOBRA	24195	mxA-1+	262,752,918	4.890%
I	BANOBRA	24241	mxA-1+	208,179,036	3.874%
I	BANOBRA	24285	mxA-1+	90,032,653	1.676%
	Reportos			100,591,569	1.872%
IS	BPA182	301010	AAA(mex)	100,591,569	1.872%
	TOTAL CARTERA			5,373,188,026	100.000%
	ACTIVO NETO			5,369,641,115	
	VAR ESTABLECIDO \$			4,295,713	0.080%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			461,130	0.009%
	Cartera al:		18-abr-24		