

INVEXCO
CLASIFICACION: CORTO PLAZO INDIZADA O COBERTURA EN DOLARES
COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES
DEL DIA 31/03/2022
CALIFICACION: AAAf/S5(mex)

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
Inversión en Dólares					
CHD	EFFECTIV			566,534,404.18	99.37%
				566,534,404.18	
				566,534,404.18	
Reportos					
IQ	BPAG91	240829	mxAAA	3,609,029.66	0.63%
				3,609,029.66	
				3,609,029.66	
CARTERA TOTAL:				570,143,433.84	100.00%
VaR ESTABLECIDO:			2.000 %		
VaR OBSERVADO PROMEDIO:			1.0353 %		

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.