



BNP PARIBAS
ASSET MANAGEMENT

El inversor
sostenible para un
mundo en evolución

BNPP-CP

AAAf/S1(mex)

CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL
MILES DE PESOS

T.Valor	Emisora	Serie	Calificación Bursatil	Valor Total	%
	Bondes D			881,677	32.076%
LD	BONDESD	220203	AAA(mex)	200,589	7.297%
LD	BONDESD	221110	AAA(mex)	200,458	7.293%
LD	BONDESD	220224	AAA(mex)	199,997	7.276%
LD	BONDESD	221013	AAA(mex)	180,541	6.568%
LD	BONDESD	220317	AAA(mex)	100,092	3.641%
	Bonos Gob. Fed. Tasa fija			393,901	14.330%
M	BONOS	230309	AAA(mex)	196,319	7.142%
M	BONOS	211209	AAA(mex)	98,814	3.595%
M	BONOS	220609	AAA(mex)	98,768	3.593%
	CEBURES			98,008	3.566%
CD	BACMEXT	20	AAA(mex)	70,390	2.561%
CD	BANOB	20-2X	AAA(mex)	27,618	1.005%
	Reportos			1,375,162	50.029%
LD	BONDESD	240822	AAA(mex)	1,375,162	50.029%
	TOTAL CARTERA			2,748,747	100.000%
	ACTIVO NETO			2,547,114	
	VAR ESTABLECIDO \$			2,547	0.100%
	VAR OBSERVADO PROMEDIO \$			-	0.000%
	Cartera al:		2/Dic/2021		

Método Histórico, 1 día con un nivel de confianza al 95% con 500 observaciones.