BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT

La gestora para un mundo en evolución

BNPP-80

N/A

DISCRECIONAL

MILES DE PESOS

T.Valor	Emisora	Serie	Calificación Bursatil	Valor Total	%
	Bonos Gob. Fed. Tasa fija			**23,549**	**13.348%**
M	BONOS	270603	AAA(mex)	12,208	6.920%
M	BONOS	310529	AAA(mex)	6,224	3.528%
M	BONOS	260305	AAA(mex)	4,508	2.555%
M	BONOS	211209	AAA(mex)	420	0.238%
M	BONOS	231207	AAA(mex)	188	0.106%
	CEBURES			**3,887**	**2.203%**
CD	KEXIM	21	Aaa.mx	1,378	0.781%
CD	BACMEXT	20	AAA(mex)	1,251	0.709%
CD	KEXIM	19	Aaa.mx	604	0.342%
CD	BANOB	17-2X	AAA(mex)	335	0.190%
CD	BACMEXT	17-2	AAA(mex)	319	0.181%
	Cert. Bursatiles Bancarios			**512**	**0.290%**
94	BACOMER	19-2	AAA(mex)	257	0.146%
94	HSBC	20	AAA(mex)	254	0.144%
	Certificado Bursatil			**8,758**	**4.964%**
91	CETELEM	19-2	AAA(mex)	2,067	1.172%
91	NM	21	AAA(mex)	1,068	0.606%
91	CETELEM	21-2	AAA(mex)	952	0.540%
91	KOF	20	AAA(mex)	850	0.482%
91	SORIANA	20-2	AA+(mex)	789	0.447%
91	DAIMLER	20-2	AAA(mex)	727	0.412%
91	LIVEPOL	19	AAA(mex)	625	0.355%
91	GPH	20	AAA(mex)	556	0.315%
91	ACBE	17	AAA(mex)	340	0.193%
91	BIMBO	17	AAA(mex)	332	0.188%
91	GMFIN	19-2	AA+(mex)	178	0.101%
91	KOF	17	mxAAA	161	0.091%
91	TOYOTA	17-2	AAA(mex)	111	0.063%
	Soc. de Inv. de Renta Variable			**24,452**	**13.860%**
52	BNPP-RV	BE0	N/A	24,452	13.860%
	TRAC Tit. ref. acciones extr.			**40,033**	**22.692%**
1ISP	VT	*	Alta	22,295	12.637%
1ISP	VWO	*	Alta	10,728	6.081%
1ISP	IYR	*	Alta	2,434	1.380%
1ISP	EZU	*	Alta	2,005	1.137%
1ISP	GSG	*	Alta	1,446	0.820%
1ISP	EWZ	*	Alta	1,125	0.638%
	Tit. Deuda de Org. Multilat.			**762**	**0.432%**
JI	BIDINV	1-21G	mxAAA	762	0.432%
	Udibonos UDIS			**65,407**	**37.075%**
S	UDIBONO	220609	AAA(mex)	24,773	14.042%
S	UDIBONO	251204	AAA(mex)	21,450	12.158%
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	14,201	8.049%
S	UDIBONO	231116	AAA(mex)	4,984	2.825%
	Valores paraestatales Rendim.			**603**	**0.342%**
95	FEFA	19-4	mxAAA	603	0.342%
	Reportos			**8,458**	**4.794%**
LD	BONDESD	230105	AAA(mex)	8,458	4.794%
	TOTAL CARTERA			**176,420**	**100.000%**
	ACTIVO NETO			**177,252**	
	VAR ESTABLECIDO $			**4,077**	**2.300%**
	VAR OBSERVADO PROMEDIO $			**1**	**0.000%**
	Cartera al:		**31-may-21**		

Método Histórico, 1 día con un nivel de confianza al 95% con 1000 observaciones.