



**VALMX14 FONDO VALMEX 2000, S.A. DE C.V., F.I.I.D.  
CARTERA DE VALORES AL 15 SEPTIEMBRE, 2021**

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
<b>INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA</b>						
<b>VALORES GUBERNAMENTALES</b>						
LD	BONDESD	211118	mxAAA	2,000,000	200,538,642.00	16.52
LD	BONDESD	220519	mxAAA	2,002,104	200,289,475.10	16.50
LD	BONDESD	220714	mxAAA	1,200,000	120,026,074.80	9.89
LD	BONDESD	230105	mxAAA	2,000,000	199,744,358.00	16.46
<b>TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA</b>					720,598,549.90	59.38
<b>TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>					720,598,549.90	59.38
<b>OPERACIONES DE REPORTO</b>						
<b>REPORTADOR</b>						
IM	BPAG28	240208	mxAAA	1,633,621	163,040,125.15	13.43
IQ	BPAG91	260903	mxAAA	1,788,991	177,363,043.09	14.61
LD	BONDESD	250220	mxAAA	1,531,706	152,616,822.85	12.58
<b>TOTAL OPERACIONES DE REPORTO</b>					493,019,991.09	40.62
<b>TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES</b>					1,213,618,540.99	100.00

**CATEGORÍA**  
CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL

**CALIFICACIÓN**  
HR AAA/2 CP

**VaR Promedio**  
0.001%

**Límite de VaR**  
0.270%

El VaR es el monto en pesos de pérdida esperada bajo condiciones normales del mercado en un intervalo de tiempo determinado a un nivel de confianza dado. Esta cifra resume la exposición de la cartera del Fondo al riesgo de mercado, suponiendo cierta probabilidad de un movimiento adverso. Actualmente se utiliza un modelo histórico que incluye 280 datos, horizonte temporal de 1 día y nivel de confianza del 97.5%.

C.P. Antonio Esteinou Madrid