



**VALMX14 FONDO VALMEX 2000, S.A. DE C.V., F.I.I.D.
CARTERA DE VALORES AL 06 JUNIO, 2019**

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
BI	CETES	200102	mxA-1+	15,280,000	145,727,056.08	47.06
BI	CETES	200227	mxA-1+	6,100,000	57,465,696.60	18.56
BI	CETES	200423	mxA-1+	800,000	7,446,214.40	2.40
M	BONOS	191211	mxAAA	443,958	44,754,556.69	14.45
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					255,393,523.77	82.48
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					255,393,523.77	82.48
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADO						
IQ	BPAG91	210826	mxAAA	271,345	27,129,399.29	8.76
LD	BONDESD	240229	mxAAA	272,312	27,129,450.20	8.76
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					54,258,849.49	17.52
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					309,652,373.26	100.00

CLASIFICACIÓN
CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL

CALIFICACIÓN
AAA/2 HR

VaR Promedio
0.051%

Límite de VaR
0.200%

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. Ernesto Díez Sánchez