

VALMX14 FONDO VALMEX 2000, S.A. DE C.V., F.I.I.D.
CARTERA DE VALORES AL 17 JUNIO, 2021

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Valor Razonable	%
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					
VALORES GUBERNAMENTALES					
LD	BONDESD	211118	AA-(mex)	200,256,160.00	17.05
LD	BONDESD	220519	AA-(mex)	200,038,495.35	17.04
LD	BONDESD	230105	AA-(mex)	200,091,720.00	17.04
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA				600,386,375.35	51.13
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR				600,386,375.35	51.13
OPERACIONES DE REPORTO					
REPORTADOR					
IM	BPAG28	210812	AA-(mex)	280,828,425.99	23.92
LD	BONDESD	240229	AA-(mex)	292,995,322.68	24.95
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO				573,823,748.67	48.87
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES				1,174,210,124.02	100.00

CLASIFICACIÓN
CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL

CALIFICACIÓN
HR AAA/2 CP

VaR Promedio
0.002%

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%.