



**VALMX15 FONDO VALMEX 15 EN BONOS DE TASA FIJA, S.A. DE C.V., F.I.I.D.
CARTERA DE VALORES AL 13 JUNIO, 2019**

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
M	BONOS	220609	mxAAA	956,770	92,790,964.53	32.63
M	BONOS	231207	mxAAA	1,791,235	181,803,705.23	63.94
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					274,594,669.76	96.57
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					274,594,669.76	96.57
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADO						
IQ	BPAG91	210826	mxAAA	493	49,386.90	0.02
LD	BONDESD	220512	mxAAA	97,071	9,659,193.71	3.40
LD	BONDESD	240425	mxAAA	495	49,392.96	0.02
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					9,757,973.57	3.43
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					284,352,643.33	100.00

CLASIFICACIÓN
LARGO PLAZO GUBERNAMENTAL

CALIFICACIÓN
AAA/4 HR

VaR Promedio
0.377%

Límite de VaR
0.867%

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