

**VALMX15 FONDO VALMEX 15 EN BONOS DE TASA FIJA, S.A. DE C.V., F.I.I.D.**  
**CARTERA DE VALORES AL 09 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>						
M	BONOS	240905	mxAAA	11,860	1,244,461.96	1.01
M	BONOS	241205	mxAAA	775,000	88,021,252.75	71.43
M	BONOS	260305	mxAAA	320,000	31,037,433.60	25.19
<b>TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA</b>					120,303,148.31	97.63
<b>TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>					120,303,148.31	97.63
<b>OPERACIONES DE REPORTO</b>						
<b>REPORTADOR</b>						
LD	BONDESD	240229	mxAAA	10,999	1,099,648.67	0.89
LD	BONDESD	241024	mxAAA	18,272	1,819,573.35	1.48
<b>TOTAL OPERACIONES DE REPORTO</b>					2,919,222.02	2.37
<b>TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES</b>					123,222,370.33	100.00

**CATEGORÍA**  
LARGO PLAZO GUBERNAMENTAL

**CALIFICACIÓN**  
HR AAA/4 LP

**VaR Promedio**  
0.330%

**Límite de VaR**  
0.831%

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%.