

**VALMX15 FONDO VALMEX 15 EN BONOS DE TASA FIJA, S.A. DE C.V., F.I.I.D.**  
**CARTERA DE VALORES AL 17 JUNIO, 2021**

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Valor Razonable	%
<b>INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA</b>					
<b>VALORES GUBERNAMENTALES</b>					
M	BONOS	240905	AA-(mex)	77,275,770.81	44.59
M	BONOS	241205	AA-(mex)	67,337,281.69	38.85
M	BONOS	260305	AA-(mex)	26,950,375.62	15.55
<b>TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA</b>				171,563,428.12	98.99
<b>TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>				171,563,428.12	98.99
<b>OPERACIONES DE REPORTO</b>					
<b>REPORTADOR</b>					
IS	BPA182	260219	AA-(mex)	1,745,567.42	1.01
<b>TOTAL OPERACIONES DE REPORTO</b>				1,745,567.42	1.01
<b>TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES</b>				173,308,995.54	100.00

**CLASIFICACIÓN**  
LARGO PLAZO GUBERNAMENTAL

**CALIFICACIÓN**  
HR AAA/4 LP

**VaR Promedio**  
0.329%

**Límite de VaR**  
0.816%

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%.