



**VALMX16 FONDO VALMEX DE DEUDA VALMEX16, 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						
S	UDIBONO	201210	mxAAA	383,090	236,678,796.24	10.33
PAPEL PRIVADO						
J1	CABEI	1-19	mxAAA	570,000	57,208,807.53	2.50
91	ACBE	17-2	mxAAA	293,838	29,541,097.06	1.29
91	BACHOCO	17	AAA(mex)	62,938	6,335,757.43	0.28
91	GAP	15	mxAAA	319,548	32,030,595.83	1.40
91	GAP	16	mxAAA	180,000	18,108,147.06	0.79
91	GRUMA	18	mxAA+	500,000	50,153,150.50	2.19
91	KOF	17-2	mxAAA	330,000	33,112,190.76	1.45
91	LAB	14	AA(mex)	346,096	34,485,171.22	1.51
91	LIVEPOL	17-2	mxAAA	340,000	34,073,514.12	1.49
91	NM	18-2	mxAA+	380,000	38,087,980.64	1.66
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					569,815,208.39	24.87
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					569,815,208.39	24.87
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADO						
IQ	BPAG91	221229	mxAAA	3,375,426	341,881,986.40	14.92
IQ	BPAG91	230427	mxAAA	5,142,162	517,146,510.63	22.57
LD	BONDESD	220512	mxAAA	30,469	3,031,863.00	0.13
LD	BONDESD	240425	mxAAA	8,608,903	859,028,553.00	37.50
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					1,721,088,913.03	75.13
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					2,290,904,121.42	100.00

CLASIFICACIÓN
DISCRECIONAL

VaR Promedio
0.029%

CALIFICACIÓN
AAA/3 HR

Límite de VaR
0.450%

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