

VALMX16 FONDO VALMEX DE DEUDA VALMEX16, S.A. DE C.V., F.I.I.D.
CARTERA DE VALORES AL 15 SEPTIEMBRE, 2021

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
BI	CETES	211202	HR1	20,000,000	197,989,820.00	5.63
LD	BONDESD	221013	mxAAA	2,000,000	199,820,966.00	5.68
LD	BONDESD	240229	mxAAA	1,000,000	99,646,036.00	2.83
LD	BONDESD	240404	mxAAA	2,006,403	200,413,871.40	5.70
LD	BONDESD	240822	mxAAA	4,500,000	449,071,236.00	12.76
LD	BONDESD	250220	mxAAA	300,000	29,855,023.20	0.85
PAPEL PRIVADO						
JI	BIDINV	1-21G	mxAAA	600,000	60,042,177.60	1.71
JI	CABEI	1-19	mxAAA	570,000	57,425,608.17	1.63
91	ACBE	17-2	mxAAA	681,550	68,352,512.51	1.94
91	BACHOCO	17	AAA(mex)	796,167	79,702,839.70	2.27
91	GAP	20	mxAAA	350,000	34,791,678.95	0.99
91	GMXT	19-2	mxAAA	500,000	49,588,203.00	1.41
91	GRUMA	18	mxAA+	840,000	84,294,269.64	2.40
91	KOF	17-2	mxAAA	345,000	34,680,439.49	0.99
91	LIVEPOL	17-2	mxAAA	340,000	34,117,009.64	0.97
91	NM	21	mxAA+	800,000	80,073,412.80	2.28
93	LAB	01021	F1+(mex)	190,000	19,022,193.33	0.54
93	LAB	01221	F1+(mex)	63,333	6,340,697.74	0.18
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					1,785,227,995.17	50.73
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					1,785,227,995.17	50.73
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADOR						
IM	BPAG28	240208	mxAAA	5,786,586	577,518,105.86	16.41
IQ	BPAG91	260903	mxAAA	5,825,213	577,519,676.92	16.41
LD	BONDESD	241219	mxAAA	5,786,670	577,519,646.27	16.41
LD	BONDESD	250220	mxAAA	10,347	1,030,959.12	0.03
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					1,733,588,388.17	49.27
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					3,518,816,383.34	100.00

CATEGORÍA
DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN
HR AAA/3 CP

VaR Promedio
0.003%

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%.