

VALMX16 FONDO VALMEX DE DEUDA VALMEX16, S.A. DE C.V., F.I.I.D.
CARTERA DE VALORES AL 17 JUNIO, 2021

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Valor Razonable	%
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					
VALORES GUBERNAMENTALES					
BI	CETES	211202	F3(mex)	196,054,820.00	5.18
LD	BONDESD	221013	AA-(mex)	200,169,702.00	5.28
LD	BONDESD	240229	AA-(mex)	99,804,968.00	2.63
LD	BONDESD	240404	AA-(mex)	200,029,231.91	5.28
LD	BONDESD	240822	AA-(mex)	298,882,476.00	7.89
LD	BONDESD	250220	AA-(mex)	29,810,499.30	0.79
PAPEL PRIVADO					
JI	BIDINV	1-21G	mxAAA	60,014,472.00	1.58
JI	CABEI	1-19	mxAAA	57,447,948.18	1.52
91	ACBE	17-2	mxAAA	68,557,931.00	1.81
91	BACHOCO	17	AAA(mex)	79,910,546.93	2.11
91	GAP	16	mxAAA	18,033,947.46	0.48
91	GAP	20	mxAAA	34,557,265.05	0.91
91	GMXT	19-2	mxAAA	49,457,175.00	1.31
91	GRUMA	18	mxAA+	84,197,581.44	2.22
91	KOF	17-2	mxAAA	34,652,100.84	0.91
91	LIVEPOL	17-2	mxAAA	34,070,431.68	0.90
91	NM	21	mxAA+	80,254,284.00	2.12
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA				1,625,905,380.79	42.92
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR				1,625,905,380.79	42.92
OPERACIONES DE REPORTO					
REPORTADOR					
IQ	BPAG91	250102	AA-(mex)	422,415,073.75	11.15
IQ	BPAG91	260507	AA-(mex)	298,234,627.97	7.87
IS	BPA182	260219	AA-(mex)	720,650,521.19	19.02
LD	BONDESD	240229	AA-(mex)	93,322.26	0.00
LD	BONDESD	250220	AA-(mex)	720,650,309.62	19.02
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO				2,162,043,854.79	57.08
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES				3,787,949,235.58	100.00

CLASIFICACIÓN
DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN
HR AAA/3 CP

VaR Promedio
0.005%

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%.