

VALMX17 FONDO VALMEX 17 EN INSTRUMENTOS DE DEUDA EN TASA REAL, S.A. DE C.V.
CARTERA DE VALORES AL 17 JUNIO, 2021

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Valor Razonable	%
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					
VALORES GUBERNAMENTALES					
S	UDIBONO	220609	AA-(mex)	361,990,196.26	57.91
S	UDIBONO	231116	AA-(mex)	168,957,242.20	27.03
S	UDIBONO	251204	AA-(mex)	25,937,790.44	4.15
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA				556,885,228.90	89.08
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR				556,885,228.90	89.08
OPERACIONES DE REPORTO					
REPORTADOR					
IS	BPA182	240307	AA-(mex)	68,255,078.12	10.92
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO				68,255,078.12	10.92
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES				625,140,307.02	100.00

CLASIFICACIÓN
MEDIANO PLAZO GUBERNAMENTAL EN UDIS

CALIFICACIÓN
HR AAA/4 CP

VaR Promedio
0.163%

Límite de VaR
0.614%

El VaR para este fondo es PIPG-Real3A + 0.45% esto quiere decir, que si se invierte una cantidad de \$10,000 pesos en el fondo y el Var indice de referencia es 0.20%, entonces la perdida maxima esperada en un día sera $0.20\% + 0.45\% = 0.65\%$ que serian \$65.00 con un nivel de confianza de 97.5%.El valor en riesgo es valido unicamente bajo condiciones normales de mercado.