



**VALMX17 FONDO VALMEX 17 EN INSTRUMENTOS DE DEUDA EN TASA REAL, S.A. DE C.V.
CARTERA DE VALORES AL 06 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	401,906	250,433,391.53	89.86
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					250,433,391.53	89.86
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					250,433,391.53	89.86
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADO						
IQ	BPAG91	240111	mxAAA	140,483	14,137,537.50	5.07
LD	BONDESD	240229	mxAAA	141,906	14,137,576.60	5.07
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					28,275,114.10	10.15
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					278,708,505.63	100.00

CLASIFICACIÓN
MEDIANO PLAZO GUBERNAMENTAL EN UDIS

CALIFICACIÓN
AAA/4 HR

VaR Promedio
0.139%

Límite de VaR
0.571%

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.

C.P. Ernesto Díez Sánchez