



**VALMX17 FONDO VALMEX 17 EN INSTRUMENTOS DE DEUDA EN TASA REAL, S.A. DE C.V.
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						
S	UDIBONO	220609	mxAAA	452,271	315,257,553.41	45.60
S	UDIBONO	231116	mxAAA	344,178	249,381,653.36	36.07
S	UDIBONO	251204	mxAAA	73,549	56,730,707.05	8.21
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					621,369,913.82	89.88
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					621,369,913.82	89.88
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADOR						
LD	BONDESD	260806	mxAAA	705,440	69,977,401.04	10.12
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					69,977,401.04	10.12
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					691,347,314.86	100.00

CATEGORÍA
MEDIANO PLAZO GUBERNAMENTAL EN UDIS

CALIFICACIÓN
HR AAA/4 CP

VaR Promedio
0.283%

Límite de VaR
0.752%

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 dia 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. Antonio Esteinou Madrid