



VALMX12 FONDO VALMEX PLUS, S.A. DE C.V., F.I.I.D.
CARTERA DE VALORES AL 27 julio, 2017



Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
INVERSION EN TITULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
BI	CETES	171026	mxA-1+	8,000,000	78,613,896.00	38.52
BI	CETES	171109	mxA-1+	11,000,000	107,802,024.00	52.82
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					186,415,920.00	91.34
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					186,415,920.00	91.34
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADO						
IQ	BPAG91	171109	mxAAA	25,077	2,543,653.62	1.25
IS	BPA182	210909	mxAAA	90,000	9,232,017.47	4.52
LD	BONDESD	171019	mxAAA	58,892	5,887,835.18	2.89
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					17,663,506.27	8.66
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					204,079,426.27	100.00

CLASIFICACIÓN
CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL

CALIFICACIÓN
AAAf/S1(mex)

VaR Promedio
0.030%

Límite de VaR
0.050%

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%.