



VALMX14 FONDO VALMEX 2000, S.A. DE C.V., F.I.I.D.
CARTERA DE VALORES AL 30 junio, 2017



Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
BI	CETES	180104	mxA-1+	3,500,000	33,761,518.00	12.90
BI	CETES	180301	mxA-1+	2,000,000	19,092,014.00	7.30
BI	CETES	180426	mxA-1+	4,500,000	42,539,004.00	16.26
BI	CETES	180524	mxA-1+	7,000,000	65,819,943.00	25.16
BI	CETES	180621	mxA-1+	10,500,000	98,212,737.00	37.54
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					259,425,216.00	99.16
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					259,425,216.00	99.16
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADO						
LD	BONDESD	171019	mxAAA	7,341	734,264.75	0.28
LD	BONDESD	220317	mxAAA	14,744	1,468,523.88	0.56
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					2,202,788.63	0.84
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					261,628,004.63	100.00

CLASIFICACIÓN
CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL

CALIFICACIÓN
AAAf/S2(mex)

VaR Promedio
0.082%

Límite de VaR
0.200%

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%.

Act. Julieta Zacarias Araujo