



VALMX12 FONDO VALMEX PLUS, 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
<b>INVERSION EN TITULOS DE DEUDA</b>						
<b>VALORES GUBERNAMENTALES</b>						
BI	CETES	170928	mxA-1+	6,000,000	58,991,472.00	27.41
BI	CETES	171012	mxA-1+	5,000,000	49,026,805.00	22.78
BI	CETES	171026	mxA-1+	8,000,000	78,229,552.00	36.34
<b>TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA</b>					<b>186,247,829.00</b>	<b>86.53</b>
<b>TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>					<b>186,247,829.00</b>	<b>86.53</b>
<b>OPERACIONES DE REPORTE</b>						
<b>REPORTADO</b>						
IS	BPA182	190103	mxAAA	187,101	19,333,884.47	8.98
LD	BONDESD	171019	mxAAA	96,647	9,666,868.98	4.49
<b>TOTAL OPERACIONES DE REPORTE</b>					<b>29,000,753.45</b>	<b>13.47</b>
<b>TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES</b>					<b>215,248,582.45</b>	<b>100.00</b>

**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%.