



VALMX15 FONDO VALMEX 15 EN BONOS DE TASA FIJA, 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
INVERSION EN TITULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
M	BONOS	210610	mxAAA	1,680,000	168,072,696.96	62.03
M	BONOS	220609	mxAAA	1,000,000	99,817,456.00	36.84
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					267,890,152.96	98.86
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					267,890,152.96	98.86
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADO						
LD	BONDESD	171019	mxAAA	10,278	1,028,030.66	0.38
LD	BONDESD	220317	mxAAA	20,644	2,056,172.47	0.76
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					3,084,203.13	1.14
TOTAL DE INVERSION EN VALORES					270,974,356.09	100.00

CLASIFICACIÓN
LARGO PLAZO GUBERNAMENTAL

VaR Promedio
0.379%

CALIFICACIÓN
AAAf/S5(mex)

Límite de VaR
0.940%

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%.