



VALMX16 FONDO VALMEX DE DEUDA VALMEX16, 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						
IS	BPA182	180104	mxAAA	233,390	23,444,365.78	1.69
M	BONOS	200611	mxAAA	1,400,000	145,954,184.60	10.50
M	BONOS	210610	mxAAA	1,250,000	125,073,743.75	9.00
S	UDIBONO	190613	mxAAA	427,617	251,537,583.65	18.09
S	UDIBONO	201210	mxAAA	176,709	100,285,439.66	7.21
PAPEL PRIVADO						
91	AC	13	mxAAA	179,981	18,086,895.43	1.30
91	BACHOCO	12	AAA(mex)	368,520	37,095,568.13	2.67
91	GAP	15	Aa1.mx	200,515	20,108,094.36	1.45
91	GAP	16	Aa1.mx	180,000	18,082,439.82	1.30
91	HERDEZ	14	mxAA-	120,000	7,207,192.44	0.52
91	KIMBER	13-2	mxAAA	380,000	38,159,734.52	2.74
91	KOF	17-2	mxAAA	330,000	33,195,045.51	2.39
91	LAB	13	AA(mex)	214,462	21,287,194.23	1.53
91	LAB	14	AA(mex)	346,096	33,509,426.23	2.41
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					873,026,908.11	62.79
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					873,026,908.11	62.79
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADO						
IS	BPA182	190704	mxAAA	3,433,412	344,839,529.71	24.80
LD	BONDES	171019	mxAAA	1,724,596	172,419,632.72	12.40
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					517,259,162.43	37.21
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					1,390,286,070.54	100.00

CLASIFICACIÓN
DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN
AAAf/S4(mex)

VaR Promedio
0.076%

Límite de VaR
0.450%

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%.