



VALMX14 FONDO VALMEX 2000, 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 |
|--|---------|--------|-----------------------|---------------|-----------------|--------------------------|
| <b>INVERSION EN TITULOS DE DEUDA</b>       |         |        |                       |               |                 |                          |
| <b>VALORES GUBERNAMENTALES</b>             |         |        |                       |               |                 |                          |
| BI   | CETES   | 180426 | mxA-1+                | 4,500,000     | 42,692,796.00   | 16.49                    |
| BI   | CETES   | 180524 | mxA-1+                | 7,000,000     | 66,051,090.00   | 25.52                    |
| BI   | CETES   | 180621 | mxA-1+                | 10,500,000    | 98,557,105.50   | 38.08                    |
| <b>TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA</b> |         |        |                       |               | 207,300,991.50  | 80.09                    |
| <b>TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>         |         |        |                       |               | 207,300,991.50  | 80.09                    |
| <b>OPERACIONES DE REPORTE</b>              |         |        |                       |               |                 |                          |
| <b>REPORTADO</b>                           |         |        |                       |               |                 |                          |
| IS   | BPA182  | 190704 | mxAAA                 | 342,040       | 34,353,265.13   | 13.27                    |
| LD   | BONDESD | 171019 | mxAAA                 | 171,806       | 17,176,618.41   | 6.64                     |
| <b>TOTAL OPERACIONES DE REPORTE</b>        |         |        |                       |               | 51,529,883.54   | 19.91                    |
| <b>TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES</b>       |         |        |                       |               | 258,830,875.04  | 100.00                   |

**CLASIFICACIÓN**  
CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL

**CALIFICACIÓN**  
AAAf/S2(mex)

**VaR Promedio**  
0.084%

**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%.