



VALMX16 FONDO VALMEX DE DEUDA VALMEX16, S.A. DE C.V., F.I.I.D.
CARTERA DE VALORES AL 30 junio, 2017



Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Titulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
INVERSION EN TITULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
IS	BPA182	180104	mxAAA	233,390	24,101,290.95	1.74
M	BONOS	200611	mxAAA	1,400,000	145,837,872.60	10.56
M	BONOS	210610	mxAAA	1,250,000	125,054,090.00	9.05
S	UDIBONO	190613	mxAAA	427,617	250,682,877.33	18.14
S	UDIBONO	201210	mxAAA	176,709	99,934,845.11	7.23
PAPEL PRIVADO						
91	AC	13	mxAAA	179,981	18,088,920.21	1.31
91	BACHOCO	12	AAA(mex)	368,520	36,905,611.55	2.67
91	GAP	15	Aa1.mx	200,515	20,116,807.94	1.46
91	GAP	16	Aa1.mx	180,000	18,091,345.14	1.31
91	HERDEZ	14	mxAAA-	120,000	7,210,402.68	0.52
91	KIMBER	13-2	mxAAA	380,000	38,175,259.80	2.76
91	KOF	17-2	mxAAA	330,000	33,020,482.11	2.39
91	LAB	13	AA(mex)	214,462	21,278,551.84	1.54
91	LAB	14	AA(mex)	346,096	33,495,918.10	2.42
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					871,994,275.36	63.12
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					871,994,275.36	63.12
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADO						
IS	BPA182	190103	mxAAA	311,202	32,157,730.40	2.33
LD	BONDES	171019	mxAAA	1,698,243	169,862,412.42	12.29
LD	BONDES	220317	mxAAA	3,087,993	307,568,601.15	22.26
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					509,588,743.97	36.88
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					1,381,583,019.33	100.00

CLASIFICACIÓN
DISCRECIONAL

VaR Promedio
0.071%

CALIFICACIÓN
AAAf/S4(mex)

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%.