

VALMX14 FONDO VALMEX 2000, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
CARTERA DE VALORES AL 28 JUNIO, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D						
LD	BONDES	240822	mxAAA	1,000,000	100,112,594.00	3.25
LD	BONDES	251016	mxAAA	1,000,000	99,981,806.00	3.25
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDES	250116	mxAAA	1,000,000	100,726,830.00	3.27
LF	BONDES	250313	mxAAA	1,000,000	100,716,737.00	3.27
LF	BONDES	260115	mxAAA	1,000,000	100,594,466.00	3.27
LF	BONDES	260604	mxAAA	1,000,000	100,523,549.00	3.27
LF	BONDES	251002	mxAAA	1,000,000	100,420,474.00	3.26
LF	BONDES	250327	mxAAA	1,000,000	100,284,465.00	3.26
LF	BONDES	260108	mxAAA	1,000,000	99,958,706.00	3.25
LF	BONDES	241107	mxAAA	700,000	70,217,398.30	2.28
LF				2,267,987	227,709,309.90	7.40
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA						
M	BONOS	240905	mxAAA	1,000,000	101,985,204.00	3.31
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IM	BPAG28	250508	mxAAA	1,500,000	151,032,820.50	4.91
CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	241114	HR1	30,500,000	292,661,408.00	9.51
BI	CETES	241003	HR1	15,000,000	145,756,470.00	4.73
BI	CETES	240919	HR1	10,000,000	97,578,960.00	3.17
BI	CETES	241017	HR1	7,038,605	68,108,829.01	2.21
BI				25,604,900	227,937,401.73	7.40
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					2,286,307,428.44	74.26
REPORTO						
IM	BPAG28	260806	mxAAA	2,688,145	269,502,210.49	8.75
IM	BPAG28	251106	mxAAA	1,238,740	123,841,089.22	4.02
IS	BPA182	280412	mxAAA	1,215,635	123,840,897.60	4.02
IQ	BPAG91	240829	mxAAA	1,225,979	123,840,815.50	4.02
IQ	BPAG91	270909	mxAAA	1,007,246	100,623,504.54	3.27
TOTAL REPORTO					741,648,517.35	24.09
OTROS VALORES				63,954	50,656,486.25	1.65
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					3,078,612,432.04	100.00

CATEGORÍA
IDCPGUB

VaR Promedio
0.007%

CALIFICACIÓN
HR AAA/1 CP

Límite de VaR
0.270%

La incertidumbre acerca del nivel futuro de las variables que inciden en el precio de las acciones del fondo, así como su eventual impacto en el mismo se refleja en la medida conocida como Valor en Riesgo. Se utiliza un modelo histórico. Se consideran los 280 escenarios más recientes de precios para cada uno de los instrumentos que componen la cartera del fondo. El horizonte temporal es un día, por tanto el VaR de la cartera en condiciones normales de mercado es la máxima pérdida esperada en un día con un nivel de confianza del 97.5%.