

VALMX17 FONDO VALMEX 17 EN INSTRUMENTOS DE DEUDA EN TASA REAL, 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 EN UDIS SEGREGABLES						
S	UDIBONO	261203	mxAAA	323,669	243,862,449.63	53.28
S	UDIBONO	251204	mxAAA	166,235	131,670,903.97	28.77
S	UDIBONO	281130	mxAAA	58,902	44,934,826.26	9.82
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					420,468,179.86	91.86
REPORTO						
LF	BONDEF	241003	mxAAA	225,422	22,654,576.74	4.95
LF	BONDEF	321021	mxAAA	147,241	14,594,891.37	3.19
TOTAL REPORTO					37,249,468.11	8.14
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					457,717,647.97	100.00

CATEGORÍA
IDMPGUBUDIS

VaR Promedio
0.219%

CALIFICACIÓN
HR AAA/4 CP

Límite de VaR
0.669%

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%.