

VALMX14 FONDO VALMEX 2000, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
CARTERA DE VALORES AL 29 NOVIEMBRE, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF				8,550,000	857,925,707.45	15.56
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES						
S	UDIBONO	251204	mxAAA	306,247	256,827,124.45	4.66
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IM	BPAG28	250508	mxAAA	1,500,000	150,420,568.50	2.73
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO SEMESTRAL DE INTERÉS Y PROTECCIÓN CONTRA LA INFLACIÓN						
IS	BPA182	250306	mxAAA	2,000,000	205,403,638.00	3.72
CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	250220	HR1	30,000,000	293,363,460.00	5.32
BI	CETES	250109	HR1	29,157,000	288,488,309.20	5.23
BI	CETES	261001	HR1	29,000,000	244,000,026.00	4.42
BI	CETES	250430	HR1	23,500,000	225,570,531.00	4.09
BI	CETES	241226	HR1	20,000,000	198,666,280.00	3.60
BI	CETES	250130	HR1	20,000,000	196,727,500.00	3.57
BI	CETES	250206	HR1	17,403,500	170,855,659.01	3.10
BI	CETES	250403	HR1	15,000,000	145,019,115.00	2.63
BI				65,986,600	619,161,406.07	11.23
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					3,852,429,324.68	69.86
REPORTO						
IQ	BPAG91	270909	mxAAA	3,928,116	399,752,402.10	7.25
IQ	BPAG91	250430	mxAAA	3,562,618	359,433,964.73	6.52
LF	BONDEF	261001	mxAAA	3,572,646	356,756,096.46	6.47
IQ	BPAG91	270506	mxAAA	3,485,661	350,553,097.39	6.36
TOTAL REPORTO					1,466,495,560.68	26.59
OTROS VALORES				1,956,777	195,504,236.86	3.55
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					5,514,429,122.22	100.00

CATEGORÍA
IDCPGUB

VaR Promedio
0.022%

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%.