

VXGUBCP FONDO VALMEX 2000, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
CARTERA DE VALORES AL 19 DICIEMBRE, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D						
LD	BONDES	251016	mxAAA	1,000,000	100,185,618.00	2.42
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDES	251002	mxAAA	1,000,000	100,563,594.00	2.43
LF	BONDES	250327	mxAAA	1,000,000	100,407,048.00	2.42
LF	BONDES	250724	mxAAA	1,000,000	100,206,520.00	2.42
LF	BONDES	260108	mxAAA	1,000,000	100,145,245.00	2.42
LF	BONDES	250116	mxAAA	1,000,000	100,022,950.00	2.42
LF	BONDES	250313	mxAAA	1,000,000	100,011,348.00	2.42
LF	BONDES	260115	mxAAA	1,000,000	99,912,513.00	2.41
LF	BONDES	260604	mxAAA	1,000,000	99,848,001.00	2.41
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES						
S	UDIBONO	251204	mxAAA	306,247	251,263,488.34	6.07
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IM	BPAG28	250508	mxAAA	1,500,000	150,007,495.50	3.62
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO SEMESTRAL DE INTERÉS Y PROTECCIÓN CONTRA LA INFLACIÓN						
IS	BPA182	250306	mxAAA	2,000,000	206,582,848.00	4.99
CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	250109	HR1	29,157,000	289,970,330.35	7.00
BI	CETES	261001	HR1	29,000,000	245,346,873.00	5.93
BI	CETES	250430	HR1	23,500,000	226,768,772.50	5.48
BI	CETES	241226	HR1	20,000,000	199,659,080.00	4.82
BI	CETES	250130	HR1	20,000,000	197,747,880.00	4.78
BI	CETES	250206	HR1	17,403,500	171,743,933.65	4.15
BI	CETES	250403	HR1	15,000,000	145,810,860.00	3.52
BI	CETES	250123	HR1	10,000,000	99,064,860.00	2.39
BI	CETES	250320	HR1	10,000,000	97,596,680.00	2.36
BI	CETES	250918	HR1	10,000,000	93,060,190.00	2.25
BI				23,285,700	212,518,509.28	5.13
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					3,488,444,637.62	84.25
REPORTO						
IQ	BPAG91	250430	mxAAA	2,704,860	274,435,629.89	6.63
IQ	BPAG91	270909	mxAAA	2,550,076	254,049,843.23	6.14
TOTAL REPORTO					528,485,473.12	12.76
OTROS VALORES				1,250,000	123,752,787.95	2.99
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					4,140,682,898.69	100.00

CATEGORÍA
IDCPGUB

VaR Promedio
0.028%

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%.