

VXUDIMP 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 09 ENERO, 2025

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	382,708.00	302,853,307.56	60.00
S	UDIBONO	281130	mxAAA	126,755.00	101,125,288.70	20.03
S	UDIBONO	251204	mxAAA	79,344.00	65,505,695.95	12.98
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					469,484,292.21	93.01
REPORTO						
IQ	BPAG91	250904	mxAAA	349,244.00	35,305,859.33	6.99
TOTAL REPORTO					35,305,859.33	6.99
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					504,790,151.54	100.00

CATEGORÍA
IDMPGUBUDIS

CALIFICACIÓN
HR AAA/4 CP

VaR Promedio
0.236%

Límite de VaR
0.716%

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%.

C.P. Antonio Esteinou Madrid