

BX+0 FONDO VALMEX 0, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
CARTERA DE VALORES AL 30 ABRIL, 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 | 251204 | mxAAA | 240,545.00 | 205,473,389.62 | 3.64 |
| CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO | | | | | | |
| BI | CETES | 250529 | HR1 | 65,000,000.00 | 645,740,550.00 | 11.44 |
| BI | CETES | 260205 | HR1 | 40,000,000.00 | 375,415,000.00 | 6.65 |
| BI | CETES | 260430 | HR1 | 40,000,000.00 | 368,628,480.00 | 6.53 |
| BI | CETES | 260305 | HR1 | 35,000,000.00 | 326,448,395.00 | 5.78 |
| BI | CETES | 270121 | HR1 | 35,000,000.00 | 304,278,730.00 | 5.39 |
| BI | CETES | 251016 | HR1 | 30,000,000.00 | 288,787,110.00 | 5.12 |
| BI | CETES | 260401 | HR1 | 30,000,000.00 | 278,178,660.00 | 4.93 |
| BI | CETES | 270318 | HR1 | 30,000,000.00 | 257,643,420.00 | 4.56 |
| BI | CETES | 250724 | HR1 | 25,000,000.00 | 245,205,950.00 | 4.34 |
| BI | CETES | 260416 | HR1 | 25,000,000.00 | 231,091,800.00 | 4.09 |
| BI | CETES | 250821 | HR1 | 20,000,000.00 | 194,854,140.00 | 3.45 |
| BI | CETES | 250807 | HR1 | 15,000,000.00 | 146,616,405.00 | 2.60 |
| BI | CETES | 250918 | HR1 | 15,000,000.00 | 145,219,950.00 | 2.57 |
| BI | CETES | 251224 | HR1 | 15,000,000.00 | 142,184,370.00 | 2.52 |
| BI | CETES | 260611 | HR1 | 15,000,000.00 | 136,943,310.00 | 2.43 |
| BI | CETES | 260806 | HR1 | 15,000,000.00 | 135,228,780.00 | 2.40 |
| BI | CETES | 261001 | HR1 | 15,000,000.00 | 133,561,905.00 | 2.37 |
| BI | | | | 20,000,000.00 | 198,397,980.00 | 3.51 |
| TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO | | | | | 4,759,898,324.62 | 84.31 |
| REPORTO | | | | | | |
| IM | BPAG28 | 260806 | mxAAA | 2,687,644.00 | 269,404,586.62 | 4.77 |
| IQ | BPAG91 | 270909 | mxAAA | 2,677,154.00 | 269,404,176.43 | 4.77 |
| IS | BPA182 | 290322 | mxAAA | 2,651,236.00 | 268,777,246.19 | 4.76 |
| TOTAL REPORTO | | | | | 807,586,009.24 | 14.31 |
| OTROS VALORES | | | | 1,890,077.93 | 77,955,705.09 | 1.38 |
| TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES | | | | | 5,645,440,038.95 | 100.00 |

CATEGORÍA
IDCP

VaR Promedio
0.041%

CALIFICACIÓN
HR AAA/2CP

Límite de VaR
0.110%

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%.

Lic. Roberto Alberto Manuel Cano Díaz