



**BX+1 FONDO VALMEX 1, S.A DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
CARTERA DE VALORES AL 31 AGOSTO, 2021**

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN						
CHM	BXM	0209582		107,110,019	107,123,871.26	22.15
TOTAL DISPONIBILIDADES					107,123,871.26	22.15
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
LD	BONDESD	220317	mxAAA	753,500	75,562,894.64	15.62
LD	BONDESD	240822	mxAAA	200,000	19,915,774.40	4.12
M	BONOS	231207	mxAAA	92,905	9,901,536.93	2.05
M	BONOS	240905	mxAAA	92,905	10,132,483.43	2.10
M	BONOS	290531	mxAAA	185,809	20,698,507.01	4.28
M	BONOS	310529	mxAAA	300,000	32,171,152.50	6.65
M	BONOS	341123	mxAAA	85,809	9,157,222.76	1.89
M	BONOS	381118	mxAAA	92,905	10,352,812.10	2.14
M	BONOS	471107	mxAAA	92,905	9,859,863.00	2.04
S	UDIBONO	220609	mxAAA	15,144	10,532,625.04	2.18
S	UDIBONO	251204	mxAAA	23,502	18,123,553.65	3.75
S	UDIBONO	281130	mxAAA	20,899	16,010,031.54	3.31
S	UDIBONO	401115	mxAAA	14,298	10,914,551.48	2.26
S	UDIBONO	461108	mxAAA	12,598	9,722,643.82	2.01
PAPEL PRIVADO						
92	FEFA	1-0321	mxA-1+	1,000,000	100,372,779.00	20.75
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					363,428,431.30	75.15
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					363,428,431.30	75.15
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADOR						
IS	BPA182	260219	mxAAA	15,017	1,500,224.58	0.31
IS	BPA182	270930	mxAAA	114,912	11,583,728.70	2.40
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					13,083,953.28	2.71
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					483,636,255.84	100.00

CATEGORÍA
DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN
HR AAA/5CP

VaR Promedio
0.255%

Límite de VaR
1.000%

La metodología de cálculo del VaR utilizada es el modelo paramétrico de volatilidad estable, con un horizonte temporal de un día que utiliza los 320 datos más recientes para componer el 50% de la volatilidad y otros 1600 datos anteriores para componer el otro 50%.