

BX+0 FONDO VALMEX 0, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
CARTERA DE VALORES AL 19 SEPTIEMBRE, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDES F	250424	mxAAA	1,000,000	100,192,451.00	2.23
CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	250529	HR1	45,000,000	420,094,935.00	9.34
BI	CETES	241114	HR1	25,000,000	246,017,750.00	5.47
BI	CETES	250724	HR1	25,000,000	230,030,425.00	5.11
BI	CETES	260416	HR1	25,000,000	215,361,675.00	4.79
BI	CETES	250220	HR1	20,000,000	191,549,780.00	4.26
BI	CETES	250821	HR1	20,000,000	182,693,360.00	4.06
BI	CETES	241017	HR1	15,000,000	148,832,415.00	3.31
BI	CETES	251224	HR1	15,000,000	132,809,310.00	2.95
BI	CETES	260611	HR1	15,000,000	127,509,585.00	2.83
BI	CETES	260806	HR1	15,000,000	125,829,915.00	2.80
BI	CETES	241031	HR1	10,000,000	98,808,850.00	2.20
BI	CETES	250206	HR1	10,000,000	96,137,680.00	2.14
BI	CETES	250306	HR1	10,000,000	95,389,150.00	2.12
BI	CETES	250320	HR1	10,000,000	95,040,020.00	2.11
BI	CETES	250403	HR1	10,000,000	94,671,940.00	2.10
BI	CETES	250515	HR1	10,000,000	93,748,020.00	2.08
BI	CETES	250626	HR1	10,000,000	92,674,110.00	2.06
CHEQUERAS EN MONEDA NACIONAL						
CHM	BXM	0209589		924,210,005	924,485,984.56	20.55
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					3,711,877,355.56	82.53
REPORTO						
LF	BONDES F	310320	mxAAA	1,952,717	193,616,561.36	4.30
LD	BONDES D	260409	mxAAA	1,927,970	193,616,531.62	4.30
LF	BONDES F	270930	mxAAA	1,230,654	122,760,661.78	2.73
IQ	BPAG91	250102	mxAAA	923,825	94,593,519.74	2.10
TOTAL REPORTO					604,587,274.50	13.44
OTROS VALORES				6,371,645	181,365,456.18	4.03
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					4,497,830,086.24	100.00

CATEGORÍA
IDCP

VaR Promedio
0.030%

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%.