

BX+0 FONDO VALMEX 0, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
CARTERA DE VALORES AL 08 MAYO, 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	206,165,462.12	3.67
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	250529	HR1	65,000,000.00	646,826,960.00	11.53
BI	CETES	270318	HR1	60,000,000.00	516,407,760.00	9.20
BI	CETES	260205	HR1	40,000,000.00	376,181,840.00	6.70
BI	CETES	260430	HR1	40,000,000.00	369,422,880.00	6.58
BI	CETES	260305	HR1	35,000,000.00	327,179,230.00	5.83
BI	CETES	270121	HR1	35,000,000.00	304,974,040.00	5.44
BI	CETES	251016	HR1	30,000,000.00	289,277,460.00	5.16
BI	CETES	260401	HR1	30,000,000.00	278,767,980.00	4.97
BI	CETES	250724	HR1	25,000,000.00	245,613,350.00	4.38
BI	CETES	260416	HR1	25,000,000.00	231,585,475.00	4.13
BI	CETES	250821	HR1	20,000,000.00	195,206,600.00	3.48
BI	CETES	250807	HR1	15,000,000.00	146,891,415.00	2.62
BI	CETES	250918	HR1	15,000,000.00	145,499,925.00	2.59
BI	CETES	251224	HR1	15,000,000.00	142,425,945.00	2.54
BI	CETES	260611	HR1	15,000,000.00	137,232,885.00	2.45
BI	CETES	260806	HR1	15,000,000.00	135,539,310.00	2.42
BI	CETES	261001	HR1	15,000,000.00	133,870,305.00	2.39
BI				20,000,000.00	198,740,360.00	3.54
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					5,027,809,182.12	89.61
REPORTO						
IM	BPAG28	271104	mxAAA	3,622,404.00	361,759,384.39	6.45
TOTAL REPORTO					361,759,384.39	6.45
OTROS VALORES				3,312,321.36	221,043,391.55	3.94
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					5,610,611,958.06	100.00

CATEGORÍA
IDCP

VaR Promedio
0.051%

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