



**BX+0 FONDO VALMEX 0, S.A DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
CARTERA DE VALORES AL 09 SEPTIEMBRE, 2021**

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN						
CHM	BXM	0209589		981,450,686	981,577,552.25	29.25
TOTAL DISPONIBILIDADES					981,577,552.25	29.25
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
IQ	BPAG91	211223	mxAAA	300,000	30,254,309.10	0.90
IS	BPA182	230907	mxAAA	1,000,000	100,489,304.00	2.99
LD	BONDESD	211007	mxAAA	2,319,197	231,936,460.84	6.91
LD	BONDESD	220127	mxAAA	3,504,666	350,387,103.66	10.44
LD	BONDESD	220317	mxAAA	3,512,614	351,447,614.21	10.47
LD	BONDESD	240201	mxAAA	1,000,000	99,917,635.00	2.98
LD	BONDESD	240404	mxAAA	1,000,000	99,789,682.00	2.97
LD	BONDESD	240822	mxAAA	2,500,000	249,248,585.00	7.43
S	UDIBONO	220609	mxAAA	72,634	50,564,585.90	1.51
PAPEL PRIVADO						
92	FEFA	1-0321	mxA-1+	2,000,000	200,264,478.00	5.97
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					1,764,299,757.71	52.58
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					1,764,299,757.71	52.58
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADOR						
IQ	BPAG91	250102	mxAAA	3,057,962	306,308,297.44	9.13
LD	BONDESD	241024	mxAAA	3,044,483	303,177,546.68	9.04
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					609,485,844.12	18.16
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					3,355,363,154.08	100.00

CATEGORÍA
CORTO PLAZO

VaR Promedio
0.004%

CALIFICACIÓN
HR AAA/3CP

Límite de VaR
0.110%

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%.