

VXDEUDA FONDO VALMEX DE DEUDA VALMEX16, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA

CARTERA DE VALORES AL 30 SEPTIEMBRE, 2026

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA						
M	BONOS	310529	mxAAA	5,120,708.00	504,953,358.97	10.38
M	BONOS	320415	mxAAA	5,070,000.00	501,724,923.57	10.32
M	BONOS	330526	mxAAA	5,295,000.00	495,546,204.33	10.19
M	BONOS	361120	mxAAA	4,223,028.00	446,757,717.47	9.19
M	BONOS	341123	mxAAA	2,672,522.00	247,679,806.07	5.09
M	BONOS	381118	mxAAA	2,647,791.00	246,114,479.68	5.06
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
91				1,983,954.00	200,049,413.85	4.11
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	270902	mxA-1+	37,468,813.00	350,634,613.34	7.21
BI	CETES	270708	mxA-1+	28,049,000.00	265,713,394.11	5.46
BI	CETES	271028	mxA-1+	27,494,420.00	254,185,692.94	5.23
BI	CETES	271223	mxA-1+	27,725,064.00	253,121,932.68	5.21
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					3,766,481,537.01	77.45
REPORTO						
IQ	BPAG91	280907	mxAAA	2,258,826.00	226,086,773.86	4.65
IS	BPA182	301010	mxAAA	2,203,114.00	226,086,675.01	4.65
LF	BONDESF	280224	mxAAA	1,708,454.00	171,236,370.36	3.52
TOTAL REPORTO					623,409,819.23	12.82
OTROS VALORES				11,419,998.83	472,953,021.88	9.73
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					4,862,844,378.12	100.00

CATEGORÍA
IDDIS

CALIFICACIÓN
HR AAA/4 CP

VaR Promedio
0.370%

Límite de VaR
0.450%

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