

VALMX10 FONDO VALMEX, S.A. DE C.V., F.I.I.D.
CARTERA DE VALORES AL 17 JUNIO, 2021

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Valor Razonable	%
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADOR					
IM	BPAG28	210812	AA-(mex)	213,529,187.52	14.54
IQ	BPAG91	250102	AA-(mex)	347,110,901.37	23.64
IS	BPA182	240307	AA-(mex)	347,111,337.53	23.64
LD	BONDESD	240229	AA-(mex)	213,529,121.34	14.54
LD	BONDESD	250220	AA-(mex)	347,111,220.21	23.64
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE				1,468,391,767.97	100.00
TOTAL DE INVERSION EN VALORES				1,468,391,767.97	100.00

CLASIFICACIÓN
CORTO PLAZO

CALIFICACIÓN
HR AAA/1 CP

VaR Promedio
0.000%

Límite de VaR
0.030%

El VaR es el monto en pesos de pérdida esperada bajo condiciones normales del mercado en un intervalo de tiempo determinado a un nivel de confianza dado. Esta cifra resume la exposición de la cartera del Fondo al riesgo de mercado, suponiendo cierta probabilidad de un movimiento adverso. Actualmente se utiliza un modelo histórico que incluye 280 datos, horizonte temporal de 1 día y nivel de confianza del 97.5%.