



**VALMX20 FONDO VALMEX DE RENDIMIENTO, S.A. DE C.V. F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 06 JUNIO, 2019**

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS ENERGÉTICAS						
1	IENOVA	*	ALTA	33,000	2,766,390.00	1.62
EMPRESAS MATERIALES						
1	ALPEK	A	ALTA	24,000	535,680.00	0.31
1	CEMEX	CPO	ALTA	953,000	7,643,060.00	4.47
1	GCC	*	ALTA	10,000	1,051,500.00	0.61
1	GMEXICO	B	ALTA	226,000	11,372,320.00	6.65
1	MEXCHEM	*	ALTA	64,000	2,609,280.00	1.52
1	PE&OLES	*	ALTA	7,700	1,801,800.00	1.05
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1	ALFA	A	ALTA	191,000	3,334,860.00	1.95
1	ASUR	B	ALTA	13,000	4,068,870.00	2.38
1	GAP	B	ALTA	23,000	4,493,280.00	2.63
1	GCARSO	A1	ALTA	30,000	2,091,000.00	1.22
1	OMA	B	ALTA	22,000	2,624,600.00	1.53
1	PINFRA	*	ALTA	14,000	2,660,980.00	1.56
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1	ALSEA	*	ALTA	33,000	1,179,420.00	0.69
1	ELEKTRA	*	ALTA	3,600	4,350,924.00	2.54
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	12,000	1,254,480.00	0.73
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1	AC	*	ALTA	24,000	2,524,560.00	1.48
1	BIMBO	A	ALTA	118,000	4,736,520.00	2.77
1	CUERVO	*	ALTA	34,000	997,220.00	0.58
1	FEMSA	UBD	ALTA	117,000	22,107,150.00	12.92
1	GRUMA	B	ALTA	13,000	2,454,010.00	1.43
1	KIMBER	A	ALTA	89,000	3,163,950.00	1.85
1	KOF	UBL	ALTA	33,000	4,119,720.00	2.41
1	WALMEX	*	ALTA	308,000	16,792,160.00	9.81
EMPRESAS DE SALUD						
1	LAB	B	ALTA	43,000	695,740.00	0.41
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1	BOLSA	A	ALTA	28,000	988,120.00	0.58
1	GENTERA	*	ALTA	62,000	1,042,840.00	0.61
1	GFINBUR	O	ALTA	142,000	3,748,800.00	2.19
1	GFNORTE	O	ALTA	182,000	18,835,180.00	11.01
1	R	A	ALTA	6,000	562,080.00	0.33
41	BBAJIO	O	ALTA	43,000	1,634,430.00	0.96
41	BSMX	B	ALTA	106,000	3,085,660.00	1.80
EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES						
1	AMX	L	ALTA	1,469,000	20,977,320.00	12.26
1	MEGA	CPO	ALTA	19,000	1,512,590.00	0.88
1	TLEVISA	CPO	ALTA	137,500	5,135,625.00	3.00
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					168,952,119.00	98.73
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					168,952,119.00	98.73
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADO						
LD	BONDESD	240229	mxAAA	21,737	2,165,577.94	1.27
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					2,165,577.94	1.27
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					171,117,696.94	100.00

CLASIFICACIÓN
ESPECIALIZADA EN ACCIONES INDIZADA AL IRT (ÍNDICE DE RENDIMIENTO TOTAL)

CALIFICACIÓN
NA

Var Promedio
2.051%

Límite de Var
2.059%

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%.

C.P. Ernesto Díez Sánchez

El accionista podrá consultar la tenencia indirecta de los Activos Objeto de Inversión en:

ISHARES <https://www.blackrock.com>
 DEUTSCHE <https://etf.deutscheam.com>
 SPDR <https://us.spdrs.com>
 WISDOMTREE <https://www.wisdomtree.com>
 FIRST TRUST <https://www.ftportfolios.com>
 POWERSHARES <https://www.invesco.com>
 VANGUARD <https://www.vanguard.com>
 OPVALMEX <http://www.valmex.com.mx/operadora-valmex>