

VALMX20 FONDO VALMEX DE RENDIMIENTO, S.A. DE C.V. F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 17 JUNIO, 2021

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Valor Razonable	%
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					
EMPRESAS MATERIALES					
1	ALPEK	A	ALTA	411,502.00	0.23
1	CEMEX	CPO	ALTA	13,743,830.00	7.69
1	GCC	*	ALTA	1,381,422.00	0.77
1	GMEXICO	B	ALTA	15,317,952.00	8.57
1	PE&OLES	*	ALTA	1,823,266.92	1.02
EMPRESAS INDUSTRIALES					
1	ALFA	A	ALTA	1,472,604.00	0.82
1	ASUR	B	ALTA	4,386,574.50	2.45
1	GAP	B	ALTA	4,723,400.00	2.64
1	GCARSO	A1	ALTA	1,208,020.00	0.68
1	OMA	B	ALTA	2,611,224.00	1.46
1	ORBIA	*	ALTA	3,107,464.00	1.74
1	PINFRA	*	ALTA	1,981,375.00	1.11
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO					
1	ALSEA	*	ALTA	1,077,282.00	0.60
1	ELEKTRA	*	ALTA	5,355,425.60	2.99
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	539,640.00	0.30
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE					
1	AC	*	ALTA	2,896,091.00	1.62
1	BIMBO	A	ALTA	3,583,228.00	2.00
1	FEMSA	UBD	ALTA	18,380,350.00	10.28
1	GRUMA	B	ALTA	2,692,920.00	1.51
1	KIMBER	A	ALTA	2,511,679.45	1.40
1	KOF	UBL	ALTA	2,697,472.00	1.51
1	LACOMER	UBC	MEDIA	895,180.00	0.50
1	WALMEX	*	ALTA	18,273,600.00	10.22
EMPRESAS DE SALUD					
1	LAB	B	ALTA	6,874,800.00	3.84
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS					
1	GFINBUR	O	ALTA	1,652,791.00	0.92
1	GFNORTE	O	ALTA	19,069,172.00	10.66
41	BBAJIO	O	ALTA	1,436,130.00	0.80
EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES					
1	AMX	L	ALTA	26,006,800.00	14.54
1	TLEVISA	CPO	ALTA	8,139,534.00	4.55
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO				174,250,729.47	97.44
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR				174,250,729.47	97.44
OPERACIONES DE REPORTO					
REPORTADOR					
IQ	BPAG91	250102	AA-(mex)	2,285,323.21	1.28
LD	BONDESD	250220	AA-(mex)	2,285,337.25	1.28
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO				4,570,660.46	2.56
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES				178,821,389.93	100.00

CLASIFICACIÓN
ESPECIALIZADA EN ACCIONES

CALIFICACIÓN
NA

VaR Promedio
2.380%

Límite de VaR
2.556%

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%.

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>