

**VALMX30 FONDO VALMEX XXI, S.A. DE C.V., F.I.I.D.**  
**CARTERA DE VALORES AL 17 JUNIO, 2021**

| Tipo Valor                              | Emisora | Serie   | Calif. / Bursatilidad | Valor Razonable | %      |
|---|---------|---------|-----------------------|-----------------|--------|
| <b>DISPONIBILIDADES</b>                 |         |         |                       |                 |        |
| <b>DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN</b> |         |         |                       |                 |        |
| CHD                                     | BANAMEX | 6740519 |                       | 9,821,820.74    | 2.31   |
| CHD                                     | BSCTIA  | 7290578 |                       | 633,582.94      | 0.15   |
| CHD                                     | CITINY  | 6385344 |                       | 44,774,674.86   | 10.53  |
| CHD                                     | MORGANS | 3048196 |                       | 368,120,654.72  | 86.55  |
| <b>TOTAL DISPONIBILIDADES</b>           |         |         |                       | 423,350,733.26  | 99.54  |
| <b>OPERACIONES DE REPORTO</b>           |         |         |                       |                 |        |
| <b>REPORTADOR</b>                       |         |         |                       |                 |        |
| IS                                      | BPA182  | 260219  | AA-(mex)              | 1,952,709.69    | 0.46   |
| <b>TOTAL OPERACIONES DE REPORTO</b>     |         |         |                       | 1,952,709.69    | 0.46   |
| <b>TOTAL DE INVERSION EN VALORES</b>    |         |         |                       | 425,303,442.95  | 100.00 |

**CLASIFICACIÓN**  
CORTO PLAZO

**CALIFICACIÓN**  
HR AAA/1 CP

**VaR Promedio**  
1.711%

**Límite de VaR**  
2.366%

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%.