



**VALMX30 FONDO VALMEX XXI, S.A. DE C.V., F.I.I.D.
CARTERA DE VALORES AL 15 SEPTIEMBRE, 2021**

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN						
CHD	BANAMEX	6740519		480,403	9,546,512.87	1.50
CHD	BSCTIA	7290578		30,990	615,823.62	0.10
CHD	CITINY	6385344		13,309,796	264,490,926.19	41.62
CHD	MORGANS	3048196		18,005,426	357,802,022.05	56.30
TOTAL DISPONIBILIDADES					632,455,284.73	99.52
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADOR						
LD	BONDESD	260806	mxAAA	30,949	3,070,042.23	0.48
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					3,070,042.23	0.48
TOTAL DE INVERSION EN VALORES					635,525,326.96	100.00

CATEGORÍA
CORTO PLAZO

CALIFICACIÓN
HR AAA/1 CP

VaR Promedio
1.468%

Límite de VaR
2.186%

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. Antonio Esteinou Madrid