



**VALMX30 FONDO VALMEX XXI, S.A. DE C.V., F.I.I.D.  
CARTERA DE VALORES AL 06 JUNIO, 2019**

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
<b>DISPONIBILIDADES</b>						
<b>DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN</b>						
CHD	BANAMEX	6740519		2,759,746	54,218,489.60	3.02
CHD	BSCTIA	7290578		5,378,742	105,670,764.74	5.88
CHD	CITINY	6385344		7,385	145,076.87	0.01
CHD	MORGANS	7048196		49,138,633	965,377,578.81	53.76
<b>TOTAL DISPONIBILIDADES</b>					1,125,411,910.02	62.67
<b>INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA</b>						
<b>VALORES GUBERNAMENTALES</b>						
D1SP	UMS19F	2019F	BBB	31,915	670,098,622.72	37.32
<b>TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA</b>					670,098,622.72	37.32
<b>TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>					670,098,622.72	37.32
<b>OPERACIONES DE REPORTO</b>						
<b>REPORTADO</b>						
IS	BPA182	200730	mxAAA	839	86,385.20	0.00
LD	BONDESD	240229	mxAAA	868	86,475.67	0.00
<b>TOTAL OPERACIONES DE REPORTO</b>					172,860.87	0.01
<b>TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES</b>					1,795,683,393.61	100.00

**CLASIFICACIÓN**  
MEDIANO PLAZO INDIZADA O COBERTURA

**CALIFICACIÓN**  
AAA/2 HR

**VaR Promedio**  
1.333%

**Límite de VaR**  
2.196%

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