



**VALMX32 FONDO VALMEX EN DOLARES S.A. DE C.V., F.I.I.D.
CARTERA DE VALORES AL 20 JUNIO, 2019**

| Tipo Valor | Emisora | Serie | Calif. / Bursatilidad | Cant. Títulos | Valor Razonable | Participación Porcentual |
|--|---------|---------|-----------------------|---------------|-----------------|--------------------------|
| DISPONIBILIDADES | | | | | | |
| DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN | | | | | | |
| CHD | BANAMEX | 2259524 | | 6,007 | 114,184.29 | 0.02 |
| CHD | CITINY | 6385432 | | 3,800,985 | 72,164,352.37 | 15.23 |
| CHD | MORGANS | 7048192 | | 11,536 | 219,012.58 | 0.05 |
| TOTAL DISPONIBILIDADES | | | | | 72,497,549.24 | 15.30 |
| INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA | | | | | | |
| VALORES GUBERNAMENTALES | | | | | | |
| D1SP | MEXC15 | 231002 | BBB | 345 | 13,864,984.38 | 2.93 |
| D1SP | MEXC46 | 270328 | BBB | 7,000 | 140,819,870.22 | 29.73 |
| D1SP | UMS19F | 2019F | BBB | 5,113 | 103,840,553.14 | 21.92 |
| D1SP | UMS22F | 2022F | BBB | 6,296 | 141,522,138.40 | 29.88 |
| TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA | | | | | 400,047,546.14 | 84.45 |
| TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR | | | | | 400,047,546.14 | 84.45 |
| OPERACIONES DE REPORTO | | | | | | |
| REPORTADO | | | | | | |
| IQ | BPAG91 | 200820 | mxAAA | 1 | 100.61 | 0.00 |
| IS | BPA182 | 250306 | mxAAA | 5,727 | 583,510.85 | 0.12 |
| LD | BONDESD | 230831 | mxAAA | 5,861 | 583,545.04 | 0.12 |
| TOTAL OPERACIONES DE REPORTO | | | | | 1,167,156.50 | 0.25 |
| TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES | | | | | 473,712,251.88 | 100.00 |

CLASIFICACIÓN
LARGO PLAZO EN INSTRUMENTOS DENOMINADOS EN DOLARES

CALIFICACIÓN
AAA/4 HR

VaR Promedio
1.383%

Límite de VaR
1.821%

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