



**VALMX32 FONDO VALMEX EN DOLARES S.A. DE C.V., F.I.I.D.
CARTERA DE VALORES AL 22 OCTUBRE, 2020**

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN						
CHD	BANAMEX	2259524		3,852	80,935.05	3.71
CHD	CITINY	6385432		152	3,183.88	0.15
CHD	MORGANS	3048192		5,132	107,824.62	4.95
TOTAL DISPONIBILIDADES					191,943.55	8.81
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
D1SP	UMS22F	2022F	BBB-	40	953,317.05	43.76
D1SP	UMS31F	2031F	BBB-	30	930,730.70	42.72
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					1,884,047.75	86.47
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					1,884,047.75	86.47
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADOR						
LD	BONDESD	240822	AA-(mex)	517	51,359.93	2.36
LD	BONDESD	241219	AA-(mex)	515	51,386.02	2.36
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					102,745.95	4.72
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					2,178,737.25	100.00

CATEGORÍA
LARGO PLAZO EN INSTRUMENTOS DENOMINADOS EN DOLARES

CALIFICACIÓN
HR AAA/4 LP

VaR Promedio
1.773%

Límite de VaR
2.234%

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%.

Ernesto Díez Sánchez