



**VALMXVL FONDO VALMEX DE CAPITALES -C-, S.A. DE C.V. F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 06 JUNIO, 2019**

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN						
CHD	BANAMEX	9112473		1,581,748	31,075,017.88	1.56
CHD	CITINY	6385723		4,885	95,970.71	0.00
TOTAL DISPONIBILIDADES					31,170,988.59	1.56
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS ENERGÉTICAS						
1ASP	APA	*	SIN BURSATILIDAD	25,000	14,164,766.00	0.71
1ASP	BP	N	SIN BURSATILIDAD	62,000	50,683,143.72	2.54
1ASP	E	N	SIN BURSATILIDAD	66,000	40,636,572.24	2.04
1ASP	HAL	*	SIN BURSATILIDAD	39,000	16,511,480.70	0.83
1ASP	OGZD	N	SIN BURSATILIDAD	150,000	20,675,450.40	1.04
1ASP	REPS	N	SIN BURSATILIDAD	63,000	20,353,187.36	1.02
1ASP	TOT	N	SIN BURSATILIDAD	30,000	31,443,423.00	1.58
EMPRESAS MATERIALES						
1ASP	CRH	N	SIN BURSATILIDAD	40,000	25,374,773.60	1.27
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1ASP	EMR	*	SIN BURSATILIDAD	28,000	34,463,013.20	1.73
1ASP	ERJ	N	SIN BURSATILIDAD	123,000	45,961,031.16	2.31
1ASP	SU	N	SIN BURSATILIDAD	34,000	54,160,908.43	2.72
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1ASP	HMC	N	SIN BURSATILIDAD	81,900	40,949,238.33	2.06
1ASP	HYUD	N	SIN BURSATILIDAD	57,660	38,061,688.90	1.91
1ASP	KGF	N	SIN BURSATILIDAD	487,000	25,203,325.30	1.26
1ASP	MKS	N	SIN BURSATILIDAD	362,000	20,169,151.82	1.01
1ASP	NSANY	N	SIN BURSATILIDAD	120,000	32,557,351.20	1.63
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1ASP	CA	N	SIN BURSATILIDAD	47,000	17,187,512.44	0.86
1ASP	CAH	*	SIN BURSATILIDAD	53,000	44,554,574.02	2.24
1ASP	IMB	N	SIN BURSATILIDAD	84,000	43,409,034.40	2.18
1ASP	MRW	N	SIN BURSATILIDAD	355,000	17,341,040.71	0.87
1ASP	PEP	*	SIN BURSATILIDAD	9,000	23,335,911.72	1.17
1ASP	SBRY	N	SIN BURSATILIDAD	493,000	23,910,006.51	1.20
1ASP	TSCO	N	SIN BURSATILIDAD	773,000	44,147,500.25	2.22
EMPRESAS DE SALUD						
1ASP	CVS	*	SIN BURSATILIDAD	19,000	20,197,856.14	1.01
1ASP	GSK	N	SIN BURSATILIDAD	95,000	72,751,102.60	3.65
1ASP	HCA	*	SIN BURSATILIDAD	10,000	24,755,924.60	1.24
1ASP	LH	*	SIN BURSATILIDAD	12,000	39,424,806.96	1.98
1ASP	MCK	*	SIN BURSATILIDAD	22,000	55,387,967.80	2.78
1ASP	MRK	*	SIN BURSATILIDAD	37,000	59,198,898.88	2.97
1ASP	PFE	*	SIN BURSATILIDAD	69,000	57,896,565.54	2.91
1ASP	SNY	N	SIN BURSATILIDAD	94,000	77,396,202.84	3.88
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1ASP	AIG	*	SIN BURSATILIDAD	35,000	36,821,515.50	1.85
1ASP	BAC	*	SIN BURSATILIDAD	90,000	49,295,743.20	2.47
1ASP	BCS	N	SIN BURSATILIDAD	106,000	15,930,941.40	0.80
1ASP	BK	*	SIN BURSATILIDAD	31,000	26,687,519.32	1.34
1ASP	CI	*	SIN BURSATILIDAD	7,000	21,139,881.84	1.06
1ASP	CS	N	SIN BURSATILIDAD	143,000	32,588,784.80	1.64
1ASP	EBO	N	SIN BURSATILIDAD	44,000	31,576,813.14	1.58
1ASP	FPAFY	N	SIN BURSATILIDAD	391,000	15,132,724.42	0.76
1ASP	HBC	N	SIN BURSATILIDAD	31,000	25,079,690.68	1.26
1ASP	JEF	*	SIN BURSATILIDAD	59,000	20,933,598.84	1.05
1ASP	PNC	*	SIN BURSATILIDAD	13,000	34,159,482.50	1.71
1ASP	SREN	N	SIN BURSATILIDAD	12,900	24,824,250.30	1.25
1ASP	STT	*	SIN BURSATILIDAD	23,000	25,403,456.76	1.27
1ASP	UBS	N	SIN BURSATILIDAD	170,000	39,309,681.40	1.97
1ASP	WFC	*	SIN BURSATILIDAD	45,000	40,596,494.40	2.04
1E	C	*	MEDIA	51,000	66,453,000.00	3.34
EMPRESAS DE TECNOLOGÍA DE LA INFORMACIÓN						
1ASP	MSFT	*	SIN BURSATILIDAD	8,000	20,089,213.76	1.01
1ASP	NOK	N	SIN BURSATILIDAD	338,000	33,334,546.96	1.67
1ASP	NXPI	N	SIN BURSATILIDAD	14,000	25,383,810.76	1.27
1ASP	SMSN	N	SIN BURSATILIDAD	1,500	27,420,904.50	1.38
EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES						
1ASP	CHL	N	SIN BURSATILIDAD	30,000	26,398,330.20	1.32
1ASP	PUB	N	SIN BURSATILIDAD	28,000	30,380,205.04	1.52
1ASP	TITR	N	SIN BURSATILIDAD	1,517,000	14,168,658.64	0.71
1ASP	VIV	N	SIN BURSATILIDAD	154,000	38,423,646.80	1.93
1ASP	WPP	N	SIN BURSATILIDAD	140,000	33,881,243.48	1.70
EMPRESAS DE SERVICIOS PÚBLICOS						
1ASP	ENGI	N	SIN BURSATILIDAD	175,000	50,336,589.80	2.53
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					1,938,014,139.21	97.26
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					1,938,014,139.21	97.26
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADO						
LD	BONDES	240229	mxAAA	26,626	2,652,651.16	0.13
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					2,652,651.16	0.13
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					1,971,837,778.96	98.96
1ASP	ENIC	N	SIN BURSATILIDAD	223,000	20,678,593.76	1.04

CLASIFICACIÓN
ESPECIALIZADA EN ACCIONES INTERNACIONALES

VaR Promedio
1.859%

CALIFICACIÓN
NA

Limite de VaR
3.750%

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%.