



VALMX32 FONDO VALMEX EN DOLARES S.A. DE C.V., F.I.I.D.
CARTERA DE VALORES AL 29 ENERO, 2021

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN						
CHD	BANAMEX	2259524		3,852	79,033.78	3.69
CHD	CITINY	6385432		1,061	21,758.98	1.02
CHD	MORGANS	3048192		5,133	105,301.04	4.92
TOTAL DISPONIBILIDADES					206,093.80	9.63
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
D1SP	UMS22F	2022F	BBB-	40	942,927.79	44.04
D1SP	UMS31F	2031F	BBB-	30	951,776.83	44.45
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					1,894,704.62	88.49
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					1,894,704.62	88.49
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADOR						
IQ	BPAG91	240111	AA-(mex)	202	20,134.92	0.94
LD	BONDESD	240425	AA-(mex)	202	20,186.58	0.94
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					40,321.50	1.88
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					2,141,119.92	100.00

CATEGORÍA	CALIFICACIÓN
LARGO PLAZO EN INSTRUMENTOS DENOMINADOS EN DOLARES	HR AAA/4 LP
VaR Promedio	Límite de VaR
1.826%	2.240%

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