



VALMX30 FONDO VALMEX XXI, S.A. DE C.V., F.I.I.D.
CARTERA DE VALORES AL 27 julio, 2017



Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN						
CHD	BANAMEX	6740519		44,921,317	796,607,049.83	26.96
CHD	BSCZIA	7290578		121,435,500	2,153,415,713.87	72.88
TOTAL DISPONIBILIDADES					2,950,022,763.70	99.83
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADO						
IQ	BPAG91	171109	mxAAA	32,147	3,260,790.07	0.11
LD	BONDES	171019	mxAAA	16,307	1,630,322.09	0.06
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					4,891,112.16	0.17
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					2,954,913,875.86	100.00

CLASIFICACIÓN
MEDIANO PLAZO INDIZADA O COBERTURA

VaR Promedio
0.674%

CALIFICACIÓN
AAAf/S6(mex)

Límite de VaR
2.575%

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%.

Act. Julieta Zacarias Araujo