



VALMX30 FONDO VALMEX XXI, S.A. DE C.V., F.I.I.D.  
CARTERA DE VALORES AL 30 junio, 2017



Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
<b>DISPONIBILIDADES</b>						
<b>DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN</b>						
CHD	BANAMEX	6740519		3,521,171	63,869,829.71	10.34
CHD	BSCZIA	7290578		30,381,231	551,054,765.88	89.18
<b>TOTAL DISPONIBILIDADES</b>					614,924,595.59	99.51
<b>OPERACIONES DE REPORTO</b>						
<b>REPORTADO</b>						
LD	BONDESD	171019	mxAAA	10,011	1,001,324.67	0.16
LD	BONDESD	220317	mxAAA	20,108	2,002,786.09	0.32
<b>TOTAL OPERACIONES DE REPORTO</b>					3,004,110.76	0.49
<b>TOTAL DE INVERSION EN VALORES</b>					617,928,706.35	100.00

**CLASIFICACIÓN**  
MEDIANO PLAZO INDIZADA O COBERTURA

**VaR Promedio**  
0.722%

**CALIFICACIÓN**  
AAAf/S6(mex)

**Límite de VaR**  
2.647%

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