OPERADORA VALMEX
DE FONDOS DE INVERSIÓN

VXCOBER FONDO VALMEX XXI, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA

CARTERA DE VALORES AL 30 OCTUBRE, 2026

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
CHEQUERAS BANCARIAS EN DÓLARES						
CHD	BACOMER	3804577		5,172,050.36	97,253,683.35	38.16
CHD	CITIMEXICO	6740519		5,136,989.51	96,594,409.65	37.90
CHD	JPMCB	0327288		1,717,684.52	32,298,824.41	12.67
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					226,146,917.41	88.74
REPORTO						
IS	BPA182	320324	mxAAA	92,306.00	9,214,035.41	3.62
IS	BPA182	320923	mxAAA	92,399.00	9,213,988.71	3.62
IM	BPAG28	280803	mxAAA	92,377.00	9,213,978.45	3.62
TOTAL REPORTO					27,642,002.57	10.85
OTROS VALORES				55,750.72	1,048,319.81	.41
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					254,837,239.79	100.00

CATEGORÍA
IDCP

CALIFICACIÓN
HR AAA/1 CP

VaR Promedio
0.841%

Límite de VaR
1.873%

La incertidumbre acerca del nivel futuro de las variables que inciden en el precio de las acciones del fondo, así como su eventual impacto en el mismo se refleja en la medida conocida como Valor en Riesgo. Se utiliza un modelo histórico. Se consideran los 280 escenarios más recientes de precios para cada uno de los instrumentos que componen la cartera del fondo. El horizonte temporal es un día, por tanto el VaR de la cartera en condiciones normales de mercado es la máxima pérdida esperada en un día con un nivel de confianza del 97.5%.

Lic. Roberto Alberto Manuel Cano Dìaz