



VALMXA FONDO DINAMICO VALMEX ALTO, S.A. DE C.V., S.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 19 MAYO, 2016

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Valor Razonable	%
DISPONIBILIDADES					
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN					
CHD	BANAMEX	9112503		4,906,955.64	1.09
TOTAL DISPONIBILIDADES				4,906,955.64	1.09
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					
EMPRESAS ENERGÉTICAS					
1ASP	MRO	*	N/A	1,045,144.12	0.23
EMPRESAS MATERIALES					
1	ALPEK	A	ALTB	11,028,710.42	2.46
1	CEMEX	CPO	ALTB	9,758,705.14	2.17
1	MEXCHEM	*	ALTB	3,668,586.72	0.82
1ASP	SHW	*	N/A	3,043,409.96	0.68
EMPRESAS INDUSTRIALES					
1	ALFA	A	ALTB	9,222,037.60	2.05
1	ASUR	B	ALTB	7,461,978.40	1.66
1	GAP	B	ALTB	3,863,998.92	0.86
1ASP	DPW	N	N/A	2,289,829.86	0.51
1ASP	UPS	*	N/A	1,913,537.25	0.43
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO					
1	ALSEA	*	ALTB	11,768,272.53	2.62
1	NEMAK	A	ALTB	3,720,829.68	0.83
1ASP	HD	*	N/A	5,220,702.28	1.16
1ASP	M	*	N/A	2,073,105.87	0.46
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE					
1	AC	*	ALTB	5,378,098.77	1.20
1	BIMBO	A	ALTB	10,462,170.60	2.33
1	FEMSA	UBD	ALTB	8,820,927.36	1.96
1	GRUMA	B	ALTB	9,863,530.11	2.20
1	LALA	B	ALTB	7,332,450.30	1.63
1	WALMEX	*	ALTB	6,815,263.89	1.52
EMPRESAS DE SALUD					
1ASP	CVS	*	N/A	4,879,748.86	1.09
1ASP	PFE	*	N/A	3,090,699.76	0.69
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS					
1	GFNORTE	O	ALTB	7,242,951.87	1.61
1	GFREGIO	O	ALTB	3,917,095.27	0.87
1	SANMEX	B	ALTB	3,569,807.40	0.79
1B	NAFTRAC	ISHRS	ALTB	42,679,163.69	9.50
1ISP	DBGR	*	N/A	1,539,316.56	0.34
1ISP	HEZU	*	N/A	1,544,636.36	0.34
1ISP	VCR	*	N/A	1,585,662.34	0.35
1ISP	VDC	*	N/A	1,529,865.92	0.34
1ISP	XLV	*	N/A	1,553,365.72	0.35
FONDOS DE INVERSIÓN DE RENTA VARIABLE					
52	VALMXES	B0		11,419,049.00	2.54
52	VALMXVL	B0	NA	13,756,108.33	3.06
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO				223,058,760.86	49.67
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR				223,058,760.86	49.67
OPERACIONES DE REPORTO					
REPORTADO					
LD	BONDESD	171019	HR AAA	221,107,820.82	49.24
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO				221,107,820.82	49.24
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES				449,073,537.32	100.00

CLASIFICACIÓN
DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN
NA

VaR Promedio
0.718%

Límite de VaR
3.350%

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%.

Composición de las Carteras de los Fondos Origen

