

VLMXTEC FONDO VALMEX DE RENDIMIENTO 1, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSIÓN EN RENTA VARIABLE
CARTERA DE VALORES AL 28 JUNIO, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
ACCIONES DEL SISTEMA INTERNACIONAL DE COTIZACIONES (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ASP	NVDA	*	ALTA	96,789	218,653,818.08	5.80
1ASP	META	*	ALTA	20,432	188,388,510.95	5.00
1ASP	GOOG	*	ALTA	49,005	164,365,455.67	4.36
1ASP	ORCL	*	ALTA	58,716	151,605,383.71	4.02
1ASP	SNPS	*	MEDIA	11,855	128,998,833.07	3.42
1ASP	AMZN	*	ALTA	36,401	128,634,150.47	3.41
1ASP	TSM	N	ALTA	40,216	127,819,494.96	3.39
1ASP	NFLX	*	ALTA	9,908	122,274,535.42	3.25
1ASP	AMD	*	ALTA	37,706	111,843,706.95	2.97
1ASP	LRCX	*	MEDIA	5,675	110,503,940.90	2.93
1ASP	MU	*	ALTA	44,709	107,533,366.36	2.85
1ASP	TSLA	*	ALTA	26,892	97,307,982.80	2.58
1ASP	NOWW	*	ALTA	5,781	83,160,869.84	2.21
1ASP	ADBE	*	ALTA	7,764	78,872,267.51	2.09
1ASP	AVGO	*	ALTA	2,686	78,858,388.65	2.09
1ASP	SHOP	N	ALTA	65,288	78,855,075.56	2.09
1ASP				1,017,246	1,688,934,131.56	44.84
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					3,666,609,912.46	97.34
REPORTO						
IQ	BPAG91	240829	mxAAA	987,588	99,760,031.20	2.65
TOTAL REPORTO					99,760,031.20	2.65
OTROS VALORES				30,849	564,114.64	0.02
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					3,766,934,058.30	100.00

CATEGORÍA
RVESACCINT

VaR Promedio
2.522%

CALIFICACIÓN
NA

Límite de VaR
5.000%

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%.