

FONDO FINAMEX GUBERNAMENTAL, S.A. DE C.V.
 FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
 FINAGUB



Calificación: AA Af/S5

DISCRECIONAL

CIFRAS EN PESOS

CARTERA DE VALORES AL 30 DE JULIO DE 2020

TIPO VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION BURSATILIDAD	VALOR RAZONABLE	% DE PART.	VAR a 1 día
	EN GUBERNAMENTAL				100.00%	
LD	BONDESD	210121	AAA(mex)	111,728,693	34.65%	425.15
BI	CETES	200806	AAA(mex)	1,325,418	0.41%	21.48
BI	CETES	200813	AAA(mex)	63,775,527	19.78%	1,178.87
BI	CETES	200820	AAA(mex)	61,492	0.02%	2.02
BI	CETES	200827	AAA(mex)	2,793,685	0.87%	164.90
BI	CETES	200917	AAA(mex)	8,535,432	2.65%	307.47
BI	CETES	201008	AAA(mex)	17,239,732	5.35%	731.75
BI	CETES	201105	AAA(mex)	2,954,876	0.92%	186.84
BI	CETES	201203	AAA(mex)	9,125,734	2.83%	657.60
BI	CETES	210128	AAA(mex)	104,938,656	32.54%	14,082.85
	TOTAL CARTERA	\$		322,479,245	100.00%	14,682.02

Características del Calculo del VaR

Metodología:	Histórico
Nivel de confianza:	95.00%
Tamaño de la muestra:	500 días
Horizonte temporal:	1 día
Promedio de VaR Semanal:	895.44
Promedio % de VaR / Valor Razonable:	0.00%
Máximo % Autorizado:	1.50%

