

FONDO ACCIONES FINAMEX, S.A. DE C.V.
FONDO DE INVERSION EN RENTA VARIABLE
F-BOLSA

ESPECIALIZADA EN RENTA VARIABLE
CIFRAS EN PESOS

CARTERA DE VALORES AL 31 DE AGOSTO DE 2020

TIPO VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION BURSATILIDAD	VALOR RAZONABLE	% DE PART.	VAR a 1 día
	GUBERNAMENTAL				0.00%	
	TOTAL EN GUBERNAMENTAL			0		
	EMPRESAS INDUSTRIALES				49.06%	
1	AC	*	Alta	67,685	1.61%	1,596.43
1	ALFA	A	Alta	50,708	1.21%	1,880.30
1	ICA	*	N/A	166	0.00%	91
1	FEMSA	UBD	Alta	431,496	10.26%	10,832
1	VESTA	*	Alta	139,204	3.31%	3,599
1	INOVA	*	Alta	191,501	4.55%	6,736
1	ORBIA	*	Alta	128,229	3.05%	4,794
1	GMEXICO	B	Alta	235,644	5.60%	8,281
1	CEMEX	CPO	Alta	194,601	4.63%	9,281
1	GRUMA	B	Alta	103,265	2.46%	2,597
1	GCC	*	Alta	235,265	5.60%	6,510
1	OMA	B	Alta	71,471	1.70%	2,943
1	PE&OLES	*	Alta	47,822	1.14%	1,975
1	PINFRA	*	Alta	46,201	1.10%	1,262
1	SITES	B-1	Alta	119,357	2.84%	3,752
	EMPRESAS COMERCIALES				27.28%	
1	ALSEA	*	Alta	47,908	0.01	1,843
1	AMX	L	Alta	657,882	0.16	17,454
1	CHDRAUI	B	Media	85,877	0.02	2,799
1	WALMEX	*	Alta	355,418	0.08	9,720
	GRUPOS FINANCIEROS				23.66%	
CF	FIBRAMQ	12	Alta	237,694	5.65%	7,835
CF	FIBRAPL	14	Alta	189,746	4.51%	5,578
CF	TERRA	13	Alta	201,806	4.80%	6,551
1	GENTERA	*	Alta	43,848	1.04%	2,024
1	GFNORTE	O	Alta	130,531	3.10%	5,290
1	Q	*	Alta	145,236	3.45%	4,613
1	R	A	Alta	45,730	1.09%	1,782
	TOTAL DE RENTA VARIABLE			4,204,291	100.00%	82,380
	TOTAL CARTERA	\$		4,204,291	100.00%	82,380

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 Mensual:	81,201
Promedio % de VaR / Valor Razonable:	1.77%
Máximo % Autorizado:	2.00%