



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 17 DE SEPTIEMBRE 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				48.67%	
1	ALFA	A	Alta	47,753	1.12%	1,770.71
1	ASUR	B	Alta	32,669	0.76%	1,151.23
1	ICA	*	N/A	159	0.00%	87
1	FEMSA	UBD	Alta	392,805	9.20%	9,861
1	VESTA	*	Alta	134,521	3.15%	3,503
1	IENOVA	*	Alta	185,495	4.34%	6,544
1	ORBIA	*	Alta	89,097	2.09%	3,331
1	GMEXICO	B	Alta	280,157	6.56%	9,846
1	CEMEX	CPO	Alta	225,649	5.28%	10,762
1	GRUMA	B	Alta	157,355	3.68%	3,957
1	GCC	*	Alta	231,625	5.42%	6,501
1	OMA	B	Alta	69,877	1.64%	2,877
1	PE&OLES	*	Alta	41,690	0.98%	1,725
1	PINFRA	*	Alta	45,431	1.06%	1,320
1	SITES	B-1	Alta	144,505	3.38%	4,343
	EMPRESAS COMERCIALES				29.60%	
1	ALSEA	*	Alta	41,663	0.01	1,635
1	AMX	L	Alta	702,617	0.16	18,641
1	CHDRAUI	B	Alta	82,111	0.02	2,930
1	LAB	B	Alta	93,663	0.02	3,868
1	WALMEX	*	Alta	344,322	0.08	9,416
	GRUPOS FINANCIEROS				21.73%	
CF	FIBRAMO	12	Alta	187,095	4.38%	6,191
CF	FIBRAPL	14	Alta	142,883	3.35%	4,200
CF	TERRA	13	Alta	151,878	3.56%	4,930
1	GENTERA	*	Alta	38,047	0.89%	1,765
1	GFNORTE	O	Alta	173,549	4.06%	7,033
1	O	*	Alta	146,670	3.43%	4,860
1	R	A	Alta	88,097	2.06%	3,482
	TOTAL DE RENTA VARIABLE			4,271,383	100.00%	84,365
	TOTAL CARTERA	\$		4,271,383	100.00%	84,365

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:	84,752
Promedio % de VaR / Valor Razonable:	1.88%
Máximo % Autorizado:	2.00%