FONDO FINAMEX GUBERNAMENTAL, S.A. DE C.V.

FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA

FINAGUB

Calificacion: AAAf/S3

DISCRECIONAL

CIFRAS EN PESOS

CARTERA DE VALORES AL 31 AGOSTO DE 2021

TIPO VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION BURSATILIDAD	VALOR RAZONABLE	% DE PART.	VAR a 1 día
	EN GUBERNAMENTAL				**100.00%**	
BI	CETES	210915	AAA(mex)	8,715,540	3.67%	199.52
BI	CETES	210923	AAA(mex)	82,729,858	34.87%	3,197.48
BI	CETES	211118	AAA(mex)	7,529,323	3.17%	537.22
BI	CETES	211230	AAA(mex)	20,035,117	8.45%	2,153.34
BI	CETES	220310	AAA(mex)	47,861,276	20.17%	11,011.04
BI	CETES	220407	AAA(mex)	48,573,675	20.47%	13,128.52
BI	CETES	211007	AAA(mex)	2,345,354	0.99%	101.51
LD	BONDESD	220113	AAA(mex)	19,448,510	8.20%	65.68
	TOTAL CARTERA	$		**237,238,653**	**100.00%**	**24,811.31**

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:	**30,565.28**
Promedio % de VaR / Valor Razonable:	**0.01%**
Máximo % Autorizado:	**1.50%**