

FONDO ACCIONES FINAMEX, S.A. DE C.V.
FONDO DE INVERSION EN RENTA VARIABLE
F-BOLSA
AGRESIVA
CIFRAS EN PESOS
CARTERA DE VALORES AL 06 DE JUNIO DE 2019

TIPO VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION BURSATILIDAD	VALOR RAZONABLE	% DE PART.	VAR a 1 día
	EN DIRECTO				16.14%	
BI	CETES	190704	AAA(mex)	397,519	16.14%	32
	TOTAL EN DIRECTO			397,519		
	EMPRESAS INDUSTRIALES				15.31%	
1	FEMSA	UBD	Alta	78,792	3.20%	1,560
1	CEMEX	CPO	Alta	76,655	3.11%	2,555
1	GCC	*	Alta	77,180	3.13%	1,585
1	ICA	*	N/A	134	0.01%	48
1	GAP	B	Alta	45,910	1.86%	1,150
1	MEXCHEM	*	Alta	49,658	2.02%	1,264
1	VESTA	*	Alta	48,720	1.98%	1,147
	EMPRESAS COMERCIALES				10.82%	
1	AMX	L	Alta	161,550	6.56%	3,426
1	WALMEX	*	Alta	104,896	4.26%	2,313
	GRUPOS FINANCIEROS				57.74%	
1	GFNORTE	O	Alta	72,236	2.93%	2,159
1B	NAFTRAC	ISHRS	Alta	1,350,309	54.81%	17,441
	TOTAL DE RENTA VARIABLE			2,066,040	83.86%	26,467
	TOTAL CARTERA	\$		2,463,559	100.00%	26,499

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:	26,744
Promedio % de VaR / Valor Razonable:	1.04%
Máximo % Autorizado:	2.00%