



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

FINADIN
Calificación: A(f)/S5
LARGO PLAZO

CIFRAS EN PESOS

CARTERA DE VALORES AL 31 AGOSTO DE 2021

TIPO	EMISORA	SERIE	CALIFICACION	VALOR	%	VAR a 1 día
VALOR			BURSATILIDAD	RAZONABLE	DE PART.	
	GUBERNAMENTAL				42.72%	
BI	CETES	210923	AAA(mex)	13,483	1.16%	0.47
BI	CETES	211118	AAA(mex)	4,009	0.34%	0.28
BI	CETES	220407	AAA(mex)	479,984	41.22%	127.54
	TOTAL EN GUBERNAMENTAL			497,476		128
	PRIVADOS				57.28%	
91	HERDEZ	13	mxAA	104,411	8.97%	198.42
91	GMFIN	19-2	mxAAA	278,741	23.94%	113.85
91	KOF	20-2	mxAAA	283,900	24.38%	0.21
	TOTAL DE PRIVADOS			667,052	57.28%	312
	TOTAL CARTERA	\$		1,164,528	100.00%	399

Características del Cálculo del VaR

Metodología:	Histórico
Nivel de confianza:	95.00%
Tamaño de la muestra:	500 días
Horizonte temporal:	1 día
Promedio de VaR Mensual:	414.48
Promedio % de VaR / Valor Razonable:	0.04%
Máximo % Autorizado:	1.50%

