

FONDO FINAMEX NABLA ASIGNACIÓN ESTRATÉGICA, S.A. DE C.V.
FONDO DE INVERSIÓN MAYORITARIAMENTE EN VALORES DE DEUDA
FINABLA

FINAMEX

ESPECIALIZADA EN RENTA VARIABLE

CIFRAS EN PESOS

CARTERA DE VALORES AL 27 DE MARZO DE 2024

TIPO VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION BURSATILIDAD	VALOR RAZONABLE	% DE PART.	VAR a 1 día
	GOBIERNAL			3,346,955	52.30%	
BI	CETES	240425	AAA(mex)	3,139,558	49.06%	653
M	BONOS	241205	AAA(mex)	207,397	3.24%	123
	INDUSTRIAL			6,968	0.11%	
1	CADU	A	Baja	6,968	0.11%	259
	MATERIALES			103,732	1.62%	
1	CEMEX	CPO	Alta	103,732	1.62%	3,730
	SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES			158,751	2.48%	
1	MEGA	CPO	Alta	120,680	1.89%	4,034
1ASP	DIS	*	N/A	38,071	0.59%	1,179
	SERVICIOS FINANCIEROS			2,267,063	35.42%	
1ISP	AAXJ	*	N/A	321,047	5.02%	5,938
1ISP	EWZ	*	N/A	311,222	4.86%	8,881
1ISP	FLOT	*	N/A	752,951	11.77%	7,269
1ISP	IEFA	*	N/A	277,368	4.33%	4,447
1ISP	LRGF	*	N/A	284,249	4.44%	5,146
1ISP	SGOV	*	N/A	320,226	5.00%	3,120
	SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BASICO			277,994	4.34%	
1	AGUILAS	CPO	Media	1,802	0.03%	
1	NEMAK	A	Media	276,192	4.32%	9,798
	TECNOLOGIA DE LA INFORMACION			238,420	3.73%	
1ASP	BABA	N	N/A	80,628	1.26%	3,869
1ASP	BIDU	N	N/A	67,817	1.06%	3,276
1ASP	META	*	N/A	89,975	1.41%	3,880
	TOTAL CARTERA			6,399,883	100.00%	37,927

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:	36,539
Promedio % de VaR / Valor Razonable:	0.58%
Máximo % Autorizado:	1.80%

*La inversión en certificados bursátiles fiduciarios inmobiliarios conlleva riesgos por el impacto que puede presentar la valuación por cambios en factores macroeconómicos como tasas de interés y tipo de cambio; así como factores que impacten los flujos de efectivo, decremento en ingresos, incremento en costos operativos que no puedan traslaparse a mayores precios, un mayor riesgo financiero por apalancamiento y riesgo de dilución, principalmente.