

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

ESPECIALIZADA EN RENTA VARIABLE

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
	GOBERNAMENTAL				78.67%	
BI	CETES	210915	AAA(mex)	4,805,899	13.99%	110
BI	CETES	210923	AAA(mex)	21,536,519	62.70%	832
M	BONOS	220609	AAA(mex)	350,342	1.02%	153
M	BONOS	241205	AAA(mex)	229,806	0.67%	706
S	UDIBONO	220609	AAA(mex)	100,152	0.29%	87
	TOTAL EN GOBERNAMENTAL			27,022,718		1,888
	EMPRESAS INDUSTRIALES				12.65%	
1	ALFA	A	Alta	890,232	2.59%	34,154
1	ASUR	B	Alta	259,870	0.76%	9,105
1	BIMBO	A	Alta	3,608	0.01%	111
1	CADU	A	Baja	5,819	0.02%	221
1	FEMSA	UBD	Alta	10,842	0.03%	281
1	GMEXICO	B	Alta	9,168	0.03%	322
1	CEMEX	CPO	Alta	5,693	0.02%	245
1	GRUMA	B	Alta	321,806	0.94%	9,245
1	KIMBER	A	Alta	454,087	1.32%	12,996
1	NEMAK	A	Media	807,173	2.35%	32,050
1	PE&OLES	*	Alta	2,277	0.01%	94
1	ORBIA	*	Alta	5,505	0.02%	204
1	OMA	B	Alta	498,983	1.45%	20,822
1	VESTA	*	Alta	1,766	0.01%	44
1	VOLAR	A	Alta	944,655	2.75%	42,851
1ESP	SRE	*	N/A	125,205	0.36%	3,453
	EMPRESAS COMERCIALES				0.65%	
1	ALSEA	*	Alta	3,455	0.01%	136
1	AMX	L	Alta	16,765	0.05%	379
1	MEGA	CPO	Alta	182,587	0.53%	5,243
1	TLEVISA	CPO	Alta	5,294	0.02%	248
1	WALMEX	*	Alta	13,577	0.04%	384
	EMPRESAS SERVICIOS				1.43%	
1ASP	BIDU	N	N/A	264,816	0.77%	11,473
1ASP	BABA	N	N/A	227,986	0.66%	7,938
	GRUPOS FINANCIEROS				6.60%	
CF	FIBRAMQ	12	Alta	4,238	0.01%	143
CF	FUNO	11	Alta	2,811	0.01%	94
1	GENTERA	*	Alta	5,746	0.02%	265
1B	NAFTRAC	ISHRS	Alta	55,164	0.16%	1,047
1ISP	AAXJ	*	N/A	766,294	2.23%	16,879
1ISP	EWZ	*	N/A	633,622	1.84%	24,541
1ISP	IEFA	*	N/A	520,840	1.52%	8,415
1ISP	LRGF	*	N/A	275,484	0.80%	4,902
41	BSMX	B	Alta	3,091	0.01%	115
	TOTAL DE RENTA VARIABLE			7,328,459	100.00%	248,400
	TOTAL CARTERA	\$		34,351,177	100.00%	138,022

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:	126,563
Promedio % de VaR / Valor Razonable:	0.35%
Máximo % Autorizado:	1.80%