

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 26 AGOSTO DE 2021

TIPO VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION BURSATILIDAD	VALOR RAZONABLE	% DE PART.	VAR a 1 día
	GOBERNAMENTAL				79.37%	
BI	CETES	210915	AAA(mex)	3,503,023	10.82%	108
BI	CETES	210923	AAA(mex)	21,523,782	66.45%	1,237
M	BONOS	220609	AAA(mex)	350,011	1.08%	157
M	BONOS	241205	AAA(mex)	229,292	0.71%	711
S	UDIBONO	220609	AAA(mex)	100,066	0.31%	87
	TOTAL EN GOBERNAMENTAL			25,706,174		2,300
	EMPRESAS INDUSTRIALES				13.09%	
1	ALFA	A	Alta	887,075	2.74%	34,032
1	ASUR	B	Alta	257,368	0.79%	9,017
1	BIMBO	A	Alta	3,527	0.01%	109
1	CADU	A	Baja	5,729	0.02%	222
1	FEMSA	UBD	Alta	10,806	0.03%	280
1	GMEXICO	B	Alta	8,731	0.03%	307
1	CEMEX	CPO	Alta	5,658	0.02%	244
1	GRUMA	B	Alta	317,709	0.98%	9,128
1	KIMBER	A	Alta	435,524	1.34%	12,465
1	NEMAK	A	Media	766,877	2.37%	30,450
1	PE&OLES	*	Alta	2,217	0.01%	92
1	ORBITA	*	Alta	5,399	0.02%	200
1	OMA	B	Alta	498,818	1.54%	20,815
1	VESTA	*	Alta	1,746	0.01%	43
1	VOLAR	A	Alta	904,331	2.79%	41,022
1ESP	SRE	*	N/A	127,138	0.39%	3,506
	EMPRESAS COMERCIALES				0.68%	
1	ALSEA	*	Alta	3,437	0.01%	135
1	AMX	L	Alta	16,171	0.05%	365
1	MEGA	CPO	Alta	182,848	0.56%	5,441
1	TLEVISIA	CPO	Alta	5,088	0.02%	239
1	WALMEX	*	Alta	13,788	0.04%	390
	EMPRESAS SERVICIOS				1.52%	
1ASP	BIDU	N	N/A	264,142	0.82%	11,451
1ASP	BABA	N	N/A	228,738	0.71%	7,945
	GRUPOS FINANCIEROS				5.34%	
CF	FIBRAMQ	12	Alta	4,003	0.01%	135
CF	FUNO	11	Alta	2,657	0.01%	89
1	GENTERA	*	Alta	5,767	0.02%	266
1B	NAFTRAC	ISHRS	Alta	54,109	0.17%	1,027
1ISP	AAXJ	*	N/A	755,428	2.33%	16,650
1ISP	EWZ	*	N/A	635,383	1.96%	24,624
1ISP	IEFA	*	N/A	236,929	0.73%	3,830
1ISP	LRGF	*	N/A	32,517	0.10%	579
41	BSMX	B	Alta	3,147	0.01%	117
	TOTAL DE RENTA VARIABLE			6,682,805	100.00%	235,215
	TOTAL CARTERA	\$		32,388,979	100.00%	127,289

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 Semanal:	103.612
Promedio % de VaR / Valor Razonable:	0.30%
Máximo % Autorizado:	1.80%