

FMXCOB - Finamex Fondo COB, S.A. de C.V. Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda
CARTERA DE VALORES AL 28 NOVIEMBRE, 2025

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual	VaR (\$)
DIRECTO							
TREASURY BILLS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)							
D4SP	TBILJ86	260115	AA+	556	1,012,345.50	93.53	10,260.92
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					1,012,345.50	93.53	10,260.92
REPORTO							
IS	BPA182	310327	mxAAA	696	69,977.02	6.47	12.71
TOTAL REPORTO					69,977.02	6.47	12.71
OTROS VALORES				0	5.49	0.00	0.00
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					1,082,328.01	100.00	10,273.63
CATEGORÍA							
CORTO PLAZO EN MONEDA EXTRANJERA							
CALIFICACIÓN		VaR Promedio		Limite de VaR			
AAA/5S&P		1.201%		2.500%			

El VAR o Valor en Riesgo (Value at Risk por sus siglas en inglés) se calcula siguiendo una metodología de simulación Monte Carlo con un 95% de confiabilidad, el número de simulaciones efectuadas son 1,000, con un horizonte de tiempo de 1 día y los factores de riesgo utilizados corresponden a 255 datos.