

FONDO FINAMEX GUBERNAMENTAL, S.A. DE C.V.
 FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA
 FINAGUB
 Calificación: AAA(f)/S2
DISCRECIONAL
 CIFRAS EN PESOS
 CARTERA DE VALORES AL 18 DE JULIO DE 2024

FINAMEX

TIPO VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION BURSATILIDAD	VALOR RAZONABLE	% DE PART.	VAR a 1 día
	GUBERNAMENTAL			507,318,694	100.00%	
BI	CETES	240725	AAA(mex)	77,766,277	15.33%	2,126
BI	CETES	240808	AAA(mex)	92,509,563	18.24%	8,486
BI	CETES	240822	AAA(mex)	42,255,822	8.33%	6,133
BI	CETES	240905	AAA(mex)	14,782,004	2.91%	1,948
BI	CETES	240926	AAA(mex)	100,396,770	19.79%	15,989
BI	CETES	241010	AAA(mex)	22,033,583	4.34%	4,500
BI	CETES	241128	AAA(mex)	55,324,326	10.91%	11,129
BI	CETES	250515	AAA(mex)	54,605,061	10.76%	32,176
BI	CETES	250710	AAA(mex)	26,967,873	5.32%	22,822
M	BONOS	270304	AAA(mex)	20,677,415	4.08%	61,703
	TOTAL CARTERA			507,318,694	100.00%	132,122

Características del Calculo del VaR

Metodología:	Histórico
Nivel de confianza:	95.00%
Tamaño de la muestra:	500 días
Horizonte temporal:	1 día
Promedio de VaR Semanal:	133,865
Promedio % de VaR / Valor Razonable:	0.03%
Máximo % Autorizado:	1.00%