

**NAFINDX Fondo de Promoción Bursátil, S. A. de C. V., Fondo de Inversión de Renta Variable.
 CARTERA DE VALORES AL 12 SEPTIEMBRE, 2024**

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
TITULOS REFERENCIADOS A ACCIONES						
1B	NAFTRAC	ISHRS	ALTA	2,602,039	135,227,966.83	96.86
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					135,227,966.83	96.86
REPORTO						
LF	BONDESF	280323	mxAAA	32,086	3,189,156.93	2.28
TOTAL REPORTO					3,189,156.93	2.28
OTROS VALORES				11,301,268	1,198,207.90	0.86
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					139,615,331.66	100.00

CATEGORÍA
 ESPECIALIZADAS EN ACCIONES INDIZADAS AL IPC

CALIFICACIÓN
 NA

VaR Promedio
 1.348%

Límite de VaR
 2.640%

ACTIVOS NETOS
 139,570,726.39

Para el cálculo del VaR se utiliza el modelo histórico con un nivel de confianza del 95%, una muestra de 500 observaciones y un horizonte de tiempo a 1 día. El VaR máximo autorizado para el Fondo es de 2.64%, lo cual indica que con un nivel de confianza del 95%, la máxima pérdida esperada en el Fondo a 1 día sería de \$ 264.00 por cada \$10,000.00. Asimismo, en dicho periodo se registró un VaR máximo de 1.8892% que representa una pérdida máxima esperada de \$188.92 por cada \$10,000.00 del fondo en 1 día.