

NAFINDX Fondo de Promoción Bursátil, S. A. de C. V., Fondo de Inversión de Renta Variable.
CARTERA DE VALORES AL 31 AGOSTO, 2021

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS MATERIALES						
1	CEMEX	CPO	ALTA	764,102	12,607,683.00	7.62
1	GCC	*	ALTA	7,900	1,280,037.00	0.77
1	GMEXICO	B	ALTA	160,404	15,005,794.20	9.06
1	PE&OLES	*	ALTA	6,630	1,886,831.70	1.14
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1	ALFA	A	ALTA	140,536	1,981,557.60	1.20
1	ASUR	B	ALTA	10,050	3,622,321.50	2.19
1	GAP	B	ALTA	18,695	4,372,386.60	2.64
1	GCARSO	A1	ALTA	24,400	1,665,788.00	1.01
1	OMA	B	ALTA	17,756	2,152,559.88	1.30
1	ORBIA	*	ALTA	52,341	3,001,232.94	1.81
1	PINFRA	*	ALTA	11,653	1,747,950.00	1.06
1	VESTA	*	ALTA	33,500	1,258,595.00	0.76
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1	ALSEA	*	ALTA	23,443	920,372.18	0.56
1	ELEKTRA	*	ALTA	2,952	4,724,085.60	2.85
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	9,213	820,417.65	0.50
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1	AC	*	ALTA	23,647	3,059,212.39	1.85
1	BIMBO	A	ALTA	69,230	3,518,268.60	2.13
1	CUERVO	*	ALTA	27,560	1,410,796.40	0.85
1	FEMSA	UBD	ALTA	102,897	17,993,598.39	10.87
1	GRUMA	B	ALTA	10,762	2,468,479.94	1.49
1	KIMBER	A	ALTA	74,357	2,637,442.79	1.59
1	KOF	UBL	ALTA	27,712	3,222,074.24	1.95
1	WALMEX	*	ALTA	248,528	17,759,810.88	10.73
EMPRESAS DE SALUD						
1	LAB	B	ALTA	37,600	730,568.00	0.44
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
00	ABACOGF	A	NULA	11,300,000	11.30	0.00
1	BOLSA	A	ALTA	23,123	961,916.80	0.58
1	GFINBUR	O	ALTA	117,290	2,255,486.70	1.36
1	GFNORTE	O	ALTA	123,240	16,339,159.20	9.87
1	Q	*	ALTA	9,100	866,775.00	0.52
1	R	A	ALTA	6,300	777,924.00	0.47
41	BBAJIO	O	ALTA	38,000	1,460,720.00	0.88
EMPRESAS DE TECNOLOGÍA DE LA INFORMACIÓN						
1	SITES	B-1	ALTA	45,000	831,150.00	0.50
EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES						
1	AMX	L	ALTA	1,087,007	21,490,128.39	12.98
1	MEGA	CPO	ALTA	13,700	958,041.00	0.58
1	TLEVISIA	CPO	ALTA	127,163	6,732,009.22	4.07
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					162,521,186.09	98.17
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					162,521,186.09	98.17
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADOR						
LD	BONDESD	230706	mxAAA	30,279	3,029,920.22	1.83
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					3,029,920.22	1.83
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					165,551,106.31	100.00

CATEGORÍA
ESPECIALIZADAS EN ACCIONES INDIZADAS AL IPC

CALIFICACIÓN
NA

VaR Promedio
1.748%

Límite de VaR
2.640%

ACTIVOS NETOS
163,843,674.30

En el cálculo del VAR se utilizó el método paramétrico con un nivel de confianza del 95% sin tomar en cuenta algún factor de decaimiento exponencial una muestra de 252 observaciones y un horizonte de tiempo a 1 día