

NAFINDX Fondo de Promoción Bursátil, S. A. de C. V., Fondo de Inversión de Renta Variable.
CARTERA DE VALORES AL 30 septiembre, 2016

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS ENERGÉTICAS						
1	ENOVA	*	ALTB	16,725	1,267,755.00	0.56
EMPRESAS MATERIALES						
1	ALPEK	A	ALTB	31,300	1,030,396.00	0.45
1	CEMEX	CPO	ALTB	1,029,184	15,808,266.24	6.94
1	GMEXICO	B	ALTB	255,139	12,088,485.82	5.30
1	MEXCHEM	*	ALTB	77,113	3,346,704.20	1.47
1	PE&OLES	*	ALTB	3,113	1,450,907.04	0.64
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1	ALFA	A	ALTB	257,389	7,788,591.14	3.42
1	ASUR	B	ALTB	11,386	3,236,698.22	1.42
1	GAP	B	ALTB	28,895	5,319,858.45	2.33
1	GCARSO	A1	ALTB	33,224	2,574,195.52	1.13
1	OHLMEX	*	ALTB	58,066	1,493,457.52	0.66
1	OMA	B	ALTB	20,656	2,361,600.48	1.04
1	PINFRA	*	ALTB	13,553	2,819,701.65	1.24
1	URBI	*	NULB	78,700	0.08	0.00
1	VOLAR	A	ALTB	64,200	2,167,392.00	0.95
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1	ALSEA	*	ALTB	11,482	755,285.96	0.33
1	ELEKTRA	*	ALTB	2,550	640,254.00	0.28
1	LIVEPOL	C-1	ALTB	12,913	2,624,438.12	1.15
1	NEMAK	A	ALTB	52,786	1,130,676.12	0.50
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1	AC	*	ALTB	30,447	3,512,670.39	1.54
1	BIMBO	A	ALTB	64,065	3,274,362.15	1.44
1	FEMSA	UBD	ALTB	151,512	27,082,770.00	11.88
1	GRUMA	B	ALTB	15,762	4,018,364.28	1.76
1	KIMBER	A	ALTB	103,457	4,537,624.02	1.99
1	KOF	L	ALTB	35,412	5,157,757.80	2.26
1	LALA	B	ALTB	45,714	1,688,218.02	0.74
1	WALMEX	*	ALTB	384,376	16,366,730.08	7.18
EMPRESAS DE SALUD						
1	LAB	B	ALTB	53,798	1,091,023.44	0.48
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
00	ABACOGF	A	NULB	11,300,000	11.30	0.00
1	BOLSA	A	ALTB	30,000	926,700.00	0.41
1	GENTERA	*	ALTB	74,958	2,616,034.20	1.15
1	GFINBUR	O	ALTB	120,385	3,683,781.00	1.62
1	GFNORTE	O	ALTB	192,250	19,547,980.00	8.58
1	GFREGIO	O	ALTB	7,315	812,184.45	0.36
1	SANMEX	B	ALTB	130,586	4,445,147.44	1.95
1B	NAFTRAC	ISHRS	ALTB	48,415	2,285,672.15	1.00
EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES						
1	AMX	L	ALTB	1,878,877	20,799,168.39	9.13
1	TLEVISIA	CPO	ALTB	177,863	17,720,490.69	7.78
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					207,471,353.36	91.04
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					207,471,353.36	91.04
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADO						
LD	BONDES	210520	HR AAA	19,093	1,894,775.15	0.83
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					1,894,775.15	0.83
OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES						
PRESTAMISTA						
1	ALSEA	*	ALTB	10,000	657,800.00	0.29
1	ALSEA	*	ALTB	14,500	953,810.00	0.42
1	ASUR	B	ALTB	4,000	1,137,080.00	0.50
1	BIMBO	A	ALTB	20,000	1,022,200.00	0.45
1	ELEKTRA	*	ALTB	3,800	954,104.00	0.42
1	FEMSA	UBD	ALTB	14,000	2,502,500.00	1.10
1	PE&OLES	*	ALTB	4,000	1,864,320.00	0.82
1B	NAFTRAC	ISHRS	ALTB	200,000	9,442,000.00	4.14
TOTAL OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES					18,533,814.00	8.13
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					227,899,942.51	100.00

CATEGORIZACIÓN

ESPECIALIZADAS EN ACCIONES INDIZADAS AL IPC

CALIFICACIÓN
NA

VaR Promedio

1.261%

Límite de VaR

4.630%

ACTIVOS NETOS

222,924,247.57

En el cálculo del VAR se utilizó el método paramétrico con un nivel de confianza del 95%, una muestra de un año de observaciones y un horizonte de tiempo de un día.