

NAFINDX Fondo de Promoción Bursátil, S. A. de C. V., Fondo de Inversión de Renta Variable.
CARTERA DE VALORES AL 06 octubre, 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	1,303,212.00	0.58
EMPRESAS MATERIALES						
1	ALPEK	A	ALTB	31,025	1,038,406.75	0.47
1	CEMEX	CPO	ALTB	929,184	14,606,772.48	6.55
1	GMEXICO	B	ALTB	255,139	12,177,784.47	5.46
1	MEXCHEM	*	ALTB	77,113	3,442,324.32	1.54
1	PE&OLES	*	ALTB	3,113	1,355,804.89	0.61
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1	ALFA	A	ALTB	257,389	7,883,825.07	3.54
1	ASUR	B	ALTB	11,386	3,341,677.14	1.50
1	GAP	B	ALTB	28,895	5,417,523.55	2.43
1	GCARSO	A1	ALTB	3,593	288,877.20	0.13
1	OHLMEX	*	ALTB	13,268	329,179.08	0.15
1	OMA	B	ALTB	20,656	2,435,135.84	1.09
1	PINFRA	*	ALTB	13,553	2,910,642.28	1.31
1	URBI	*	NULB	78	0.00	0.00
1	VOLAR	A	ALTB	64,200	2,220,036.00	1.00
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1	ALSEA	*	ALTB	11,482	772,279.32	0.35
1	ELEKTRA	*	ALTB	1,950	489,411.00	0.22
1	LIVEPOL	C-1	ALTB	12,913	2,650,134.99	1.19
1	NEMAK	A	ALTB	52,786	1,107,450.28	0.50
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1	AC	*	ALTB	30,447	3,645,419.31	1.63
1	BIMBO	A	ALTB	55,565	2,916,606.85	1.31
1	FEMSA	UBD	ALTB	146,112	26,552,933.76	11.91
1	GRUMA	B	ALTB	15,762	4,041,219.18	1.81
1	KIMBER	A	ALTB	103,457	4,520,036.33	2.03
1	KOF	L	ALTB	35,412	5,305,779.96	2.38
1	LALA	B	ALTB	45,714	1,714,732.14	0.77
1	WALMEX	*	ALTB	384,376	16,359,042.56	7.34
EMPRESAS DE SALUD						
1	LAB	B	ALTB	53,798	1,113,080.62	0.50
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
00	ABACOGF	A	NULB	11,300,000	11.30	0.00
1	BOLSA	A	ALTB	7,000	216,720.00	0.10
1	GENTERA	*	ALTB	74,958	2,732,968.68	1.23
1	GFINBUR	O	ALTB	120,385	3,729,527.30	1.67
1	GFNORTE	O	ALTB	185,850	19,765,147.50	8.86
1	GFREGIO	O	ALTB	7,315	821,620.80	0.37
1	SANMEX	B	ALTB	130,586	4,574,427.58	2.05
1B	NAFTRAC	ISHRS	ALTB	168,415	8,063,710.20	3.62
EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES						
1	AMX	L	ALTB	1,878,877	20,799,168.39	9.33
1	TLEVISA	CPO	ALTB	177,863	17,724,047.95	7.95
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					208,366,677.07	93.43
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					208,366,677.07	93.43
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADO						
LD	BONDESD	201126	HR AAA	7,384	730,359.19	0.33
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					730,359.19	0.33
OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES						
PRESTAMISTA						
1	ALPEK	A	ALTB	275	9,204.25	0.00
1	ALSEA	*	ALTB	10,000	672,600.00	0.30
1	ALSEA	*	ALTB	14,500	975,270.00	0.44
1	ASUR	B	ALTB	4,000	1,173,960.00	0.53
1	BIMBO	A	ALTB	20,000	1,049,800.00	0.47
1	BIMBO	A	ALTB	8,500	446,165.00	0.20
1	BOLSA	A	ALTB	23,000	712,080.00	0.32
1	ELEKTRA	*	ALTB	4,400	1,104,312.00	0.50
1	FEMSA	UBD	ALTB	14,000	2,544,220.00	1.14
1	GCARSO	A1	ALTB	29,631	2,382,332.40	1.07
1	OHLMEX	*	ALTB	44,798	1,111,438.38	0.50
1	PE&OLES	*	ALTB	4,000	1,742,120.00	0.78
TOTAL OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES					13,923,502.03	6.24
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					223,020,538.29	100.00

CATEGORIZACIÓN
ESPECIALIZADAS EN ACCIONES INDIZADAS AL IPC

CALIFICACIÓN
NA

VaR Promedio

Límite de VaR

1.273%

4.630%

ACTIVOS NETOS

225,345,247.78

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.