

NAFINDX Fondo de Promoción Bursátil, S. A. de C. V., Fondo de Inversión de Renta Variable.
CARTERA DE VALORES AL 31 OCTUBRE, 2019

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS ENERGÉTICAS						
1	ENOVIA	*	ALTA	29,147	2,478,369.41	1.81
EMPRESAS MATERIALES						
1	ALPEK	A	ALTA	9,300	192,696.00	0.14
1	CEMEX	CPO	ALTA	809,102	5,849,807.46	4.28
1	GCC	*	ALTA	13,200	1,419,396.00	1.04
1	GMEXICO	B	ALTA	170,639	8,646,278.13	6.32
1	PE&OLES	*	ALTA	5,654	1,305,169.36	0.95
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1	ALFA	A	ALTA	162,689	2,713,652.52	1.98
1	ASUR	B	ALTA	10,850	3,422,524.00	2.50
1	GAP	B	ALTA	19,395	3,911,583.60	2.86
1	GCARSO	A1	ALTA	16,000	1,030,400.00	0.75
1	OMA	B	ALTA	19,756	2,634,857.72	1.93
1	ORBITA	*	ALTA	52,341	2,172,674.91	1.59
1	PINFRA	*	ALTA	11,653	2,073,534.82	1.52
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1	ALSEA	*	ALTA	23,443	1,203,094.76	0.88
1	ELEKTRA	*	ALTA	2,952	4,127,073.12	3.02
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	8,713	854,048.26	0.62
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1	AC	*	ALTA	20,147	2,165,198.09	1.58
1	BIMBO	A	ALTA	79,130	2,828,106.20	2.07
1	CUERVO	*	ALTA	33,960	1,128,830.40	0.83
1	FEMSA	UBD	ALTA	98,397	16,796,367.90	12.28
1	GRUMA	B	ALTA	10,762	2,172,309.70	1.59
1	KIMBER	A	ALTA	74,357	2,884,308.03	2.11
1	KOF	UBL	ALTA	27,712	2,929,435.52	2.14
1	WALMEX	*	ALTA	257,876	14,887,181.48	10.88
EMPRESAS DE SALUD						
1	LAB	B	ALTA	37,600	763,656.00	0.56
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
00	ABACOGF	A	NULA	11,300,000	11.30	0.00
1	BOLSA	A	ALTA	23,123	975,328.14	0.71
1	ENTERA	*	ALTA	60,958	1,161,859.48	0.85
1	GFINBUR	O	ALTA	117,290	2,803,231.00	2.05
1	GFINORTE	O	ALTA	130,196	13,670,580.00	9.99
1	R	A	ALTA	5,615	573,740.70	0.42
41	BBAJIO	O	ALTA	38,000	1,177,620.00	0.86
41	BSMX	B	ALTA	5,511	142,349.13	0.10
EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES						
1	AMX	L	ALTA	1,197,680	18,252,643.20	13.34
1	MEGA	CPO	ALTA	13,700	1,082,711.00	0.79
1	TLEVISA	CPO	ALTA	134,663	5,720,484.24	4.18
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					136,151,111.58	99.52
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					136,151,111.58	99.52
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADO						
LD	BONDESD	220113	mxAAA	6,533	650,708.26	0.48
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					650,708.26	0.48
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					136,801,819.84	100.00

CATEGORIZACIÓN
ESPECIALIZADAS EN ACCIONES INDIZADAS AL IPC

CALIFICACIÓN
NA

VaR Promedio
1.744%

Límite de VaR
1.800%

ACTIVOS NETOS
136,683,530.15

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.