

NAFINDX Fondo de Promoción Bursátil, S. A. de C. V., Fondo de Inversión de Renta Variable.
CARTERA DE VALORES AL 22 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	IENOVA	*	ALTB	16,725	1,257,887.25	0.55
EMPRESAS MATERIALES						
1	ALPEK	A	ALTB	11,300	364,651.00	0.16
1	CEMEX	CPO	ALTB	1,029,184	15,746,515.20	6.88
1	GMEXICO	B	ALTB	255,139	11,922,645.47	5.21
1	MEXCHEM	*	ALTB	77,113	3,416,877.03	1.49
1	PE&OLES	*	ALTB	3,113	1,505,477.93	0.66
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1	ALFA	A	ALTB	257,389	7,644,453.30	3.34
1	ASUR	B	ALTB	11,386	3,257,876.18	1.42
1	GAP	B	ALTB	28,895	5,175,961.35	2.26
1	GCARSO	A1	ALTB	33,224	2,629,347.36	1.15
1	OHLMEX	*	ALTB	58,066	1,492,296.20	0.65
1	OMA	B	ALTB	20,656	2,313,265.44	1.01
1	PINFRA	*	ALTB	13,553	2,888,144.30	1.26
1	URBI	*	NULB	78,700	0.08	0.00
1	VOLAR	A	ALTB	64,200	2,205,912.00	0.96
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1	ALSEA	*	ALTB	25,982	1,776,389.34	0.78
1	ELEKTRA	*	ALTB	1,350	339,160.50	0.15
1	LIVEPOL	C-1	ALTB	5,237	1,067,981.41	0.47
1	NEMAK	A	ALTB	52,786	1,092,142.34	0.48
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1	AC	*	ALTB	30,447	3,611,318.67	1.58
1	BIMBO	A	ALTB	64,065	3,396,726.30	1.48
1	FEMSA	UBD	ALTB	92,212	16,574,184.88	7.24
1	GRUMA	B	ALTB	15,762	4,132,165.92	1.81
1	KIMBER	A	ALTB	103,457	4,603,836.50	2.01
1	KOF	L	ALTB	35,412	5,250,891.36	2.29
1	LALA	B	ALTB	44,912	1,745,280.32	0.76
1	WALMEX	*	ALTB	384,376	16,720,356.00	7.31
EMPRESAS DE SALUD						
1	LAB	B	ALTB	53,798	1,097,479.20	0.48
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
00	ABACOGF	A	NULB	11,300,000	11.30	0.00
1	BOLSA	A	ALTB	10,000	309,900.00	0.14
1	GENTERA	*	ALTB	35,212	1,214,814.00	0.53
1	GFINBUR	O	ALTB	104,921	3,422,523.02	1.50
1	GFNORTE	O	ALTB	181,650	19,427,467.50	8.49
1	GFREGIO	O	ALTB	4,538	513,111.66	0.22
1	SANMEX	B	ALTB	68,218	2,354,885.36	1.03
1B	NAFTRAC	ISHRS	ALTB	148,415	7,120,951.70	3.11
EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES						
1	AMX	L	ALTB	1,771,877	20,341,147.96	8.89
1	TLEVISA	CPO	ALTB	177,863	17,987,285.19	7.86
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					195,921,320.52	85.62
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					195,921,320.52	85.62
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADO						
LD	BONDESD	200402	HR AAA	33,488	3,318,846.11	1.45
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					3,318,846.11	1.45
OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES						
PRESTAMISTA						
1	ALPEK	A	ALTB	20,000	645,400.00	0.28
1	ALSEA	*	ALTB	10,000	683,700.00	0.30
1	ASUR	B	ALTB	4,000	1,144,520.00	0.50
1	BIMBO	A	ALTB	20,000	1,060,400.00	0.46
1	BOLSA	A	ALTB	20,000	619,800.00	0.27
1	ELEKTRA	*	ALTB	5,000	1,256,150.00	0.55
1	FEMSA	UBD	ALTB	14,000	2,516,360.00	1.10
1	FEMSA	UBD	ALTB	50,000	8,987,000.00	3.93
1	GENTERA	*	ALTB	39,746	1,371,237.00	0.60
1	GFINBUR	O	ALTB	15,464	504,435.68	0.22
1	GFREGIO	O	ALTB	2,777	313,995.39	0.14
1	LALA	B	ALTB	802	31,165.72	0.01
1	LIVEPOL	C-1	ALTB	7,676	1,565,366.68	0.68
1	PE&OLES	*	ALTB	4,000	1,934,440.00	0.85
1	SANMEX	B	ALTB	62,368	2,152,943.36	0.94
1B	NAFTRAC	ISHRS	ALTB	100,000	4,798,000.00	2.10
TOTAL OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES					29,584,913.83	12.93
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					228,825,080.46	100.00

CATEGORIZACIÓN
ESPECIALIZADAS EN ACCIONES INDIZADAS AL IPC

CALIFICACIÓN
NA

VaR Promedio
1.259%

Limite de VaR
4.630%

ACTIVOS NETOS
227,081,233.53

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.