

NAFCGUB Fondo Cuasigubernamental Nafinsa, S.A. de C.V., Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda.
CARTERA DE VALORES AL 30 septiembre, 2016

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
TÍTULOS BANCARIOS						
CD	NAFR	190417	mxAAA	50,000	5,011,291.15	8.22
I	BACMEXT	16401	F1+(mex)	16,810,563	16,810,563.00	27.57
PAPEL PRIVADO						
95	CFE	13	AAA(mex)	70,000	6,930,861.00	11.37
95	FEFA	P16	AAA(mex)	50,000	5,053,419.55	8.29
95	FEFA	15-8	AAA(mex)	50,000	5,016,999.95	8.23
95	PEMEX	11-3	AAA(mex)	11,000	1,086,932.77	1.78
95	PEMEX	12	AAA(mex)	40,000	3,960,039.48	6.49
95	PEMEX	13-2	AAA(mex)	40,000	3,696,468.76	6.06
95	PEMEX	15	AAA(mex)	50,000	4,917,405.40	8.06
95	PEMEX	16	AAA(mex)	84,040	8,498,104.13	13.94
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					60,982,085.19	100.00
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					60,982,085.19	100.00
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					60,982,085.19	100.00

CATEGORIZACIÓN
MEDIANO PLAZO

CALIFICACIÓN
AAA/4-F

VaR Promedio

Limite de VaR

0.072%

0.230%

ACTIVOS NETOS
60,925,939.02

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.

Lic. Juan Manuel Pérez Porrúa