

NAFFP28 Fondo de Rendimiento Nafinsa, S. A. de C. V., Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda.
CARTERA DE VALORES AL 06 octubre, 2016

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
IM	BPAG28	170518	mxAAA	500,000	49,971,981.50	18.38
IM	BPAG28	171123	mxAAA	500,000	49,959,820.00	18.37
LD	BONDESD	170427	HR AAA	300,000	30,067,026.90	11.06
LD	BONDESD	180816	HR AAA	300,000	30,005,885.70	11.03
LD	BONDESD	180927	HR AAA	300,000	29,945,787.60	11.01
TÍTULOS BANCARIOS						
94	VWBANK	14	Aaa.mx	112,226	11,243,395.81	4.13
PAPEL PRIVADO						
95	CFE	14	mxAAA	100,000	9,836,125.60	3.62
95	FEFA	P16	AAA(mex)	200,000	20,225,484.00	7.44
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					231,255,507.11	85.04
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					231,255,507.11	85.04
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADO						
LD	BONDESD	181227	HR AAA	408,175	40,680,819.00	14.96
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					40,680,819.00	14.96
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					271,936,326.11	100.00

CATEGORIZACIÓN
MEDIANO PLAZO GUBERNAMENTAL

CALIFICACIÓN
AAA/4-F

VaR Promedio
0.008%

Límite de VaR
0.340%

ACTIVOS NETOS
271,773,435.37

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.