

**NAFGUBD Fondo Gubernamental Diario 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
<b>TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>						
<b>INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA</b>						
<b>VALORES GUBERNAMENTALES</b>						
LD	BONDESD	170223	HR AAA	200,000	20,053,076.00	26.71
LD	BONDESD	180816	HR AAA	100,000	9,995,979.50	13.31
LD	BONDESD	180927	HR AAA	200,000	19,951,836.20	26.57
LD	BONDESD	191205	HR AAA	100,000	9,967,468.90	13.27
<b>TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA</b>					59,968,360.60	79.86
<b>TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>					59,968,360.60	79.86
<b>OPERACIONES DE REPORTO</b>						
<b>REPORTADO</b>						
LD	BONDESD	171019	HR AAA	151,290	15,122,801.18	20.14
<b>TOTAL OPERACIONES DE REPORTO</b>					15,122,801.18	20.14
<b>TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES</b>					75,091,161.78	100.00

**CATEGORIZACIÓN**  
MEDIANO PLAZO GUBERNAMENTAL

**CALIFICACIÓN**  
AAA/3-F

**VaR Promedio**  
0.004%

**Límite de VaR**  
0.050%

**ACTIVOS NETOS**  
75,074,342.59

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.