



**NAFM-EX Fondo de Conservación Patrimonial 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	170223	mxAAA	1,900,000	189,944,996.90	2.73
IM	BPAG28	170518	mxAAA	1,000,000	99,943,963.00	1.44
IM	BPAG28	171123	mxAAA	3,000,000	299,758,920.00	4.31
IM	BPAG28	180222	mxAAA	2,000,000	199,612,890.00	2.87
IM	BPAG28	180726	mxAAA	1,980,000	197,765,946.18	2.84
LD	BONDESD	170622	HR AAA	1,000,000	100,210,203.00	1.44
LD	BONDESD	171019	HR AAA	1,000,000	100,086,653.00	1.44
LD	BONDESD	180215	HR AAA	2,041,667	204,032,015.31	2.93
LD	BONDESD	180419	HR AAA	1,000,000	99,805,738.00	1.43
LD	BONDESD	180614	HR AAA	2,000,000	199,566,700.00	2.87
LD	BONDESD	180628	HR AAA	2,000,000	199,906,114.00	2.87
LD	BONDESD	180816	HR AAA	2,000,000	200,039,238.00	2.87
LD	BONDESD	181011	HR AAA	3,000,000	299,882,949.00	4.31
LD	BONDESD	181213	HR AAA	2,400,000	239,631,460.80	3.44
LD	BONDESD	181227	HR AAA	2,100,000	209,298,707.10	3.01
LD	BONDESD	190328	HR AAA	3,007,172	300,363,249.84	4.32
LD	BONDESD	190606	HR AAA	3,000,000	299,006,025.00	4.30
LD	BONDESD	190627	HR AAA	2,000,000	199,471,558.00	2.87
LD	BONDESD	191205	HR AAA	3,400,000	339,116,911.20	4.87
LD	BONDESD	200130	mxAAA	2,000,000	199,426,900.00	2.87
LD	BONDESD	200402	HR AAA	3,000,000	298,759,791.00	4.29
LD	BONDESD	200528	HR AAA	2,000,000	199,124,958.00	2.86
LD	BONDESD	201126	HR AAA	2,352,727	233,561,836.92	3.36
LD	BONDESD	210121	HR AAA	2,000,000	198,504,256.00	2.85
LD	BONDESD	210325	HR AAA	3,000,000	298,408,221.00	4.29
LD	BONDESD	210520	HR AAA	1,009,160	100,353,714.21	1.44
M	BONOS	210610	HR AAA	200,000	20,945,634.00	0.30
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					5,526,529,549.46	79.40
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					5,526,529,549.46	79.40
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADO						
LD	BONDESD	180628	HR AAA	9,346,879	933,527,716.56	13.41
LD	BONDESD	190328	HR AAA	1,005,635	100,013,161.05	1.44
LD	BONDESD	200924	HR AAA	4,024,830	400,052,422.17	5.75
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					1,433,593,299.78	20.60
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					6,960,122,849.24	100.00

CATEGORIZACIÓN
MEDIANO PLAZO GUBERNAMENTAL

CALIFICACIÓN
AAA/5-F

VaR Promedio
0.004%

Límite de VaR
0.300%

ACTIVOS NETOS
6,939,195,953.64

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.

L. C. Fabián Fuentes Calixto