

**NAFMEX7 Fondo Líquido 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>						
IM	BPAG28	170518	mxAAA	500,000	50,113,132.50	23.74
IM	BPAG28	171123	mxAAA	500,000	49,934,901.00	23.65
LD	BONDESD	180816	HR AAA	500,000	49,979,897.50	23.68
LD	BONDESD	180927	HR AAA	200,000	19,951,836.20	9.45
<b>TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA</b>					169,979,767.20	80.52
<b>TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>					169,979,767.20	80.52
<b>OPERACIONES DE REPORTO</b>						
<b>REPORTADO</b>						
LD	BONDESD	180628	HR AAA	411,951	41,121,303.55	19.48
<b>TOTAL OPERACIONES DE REPORTO</b>					41,121,303.55	19.48
<b>TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES</b>					211,101,070.75	100.00

**CATEGORIZACIÓN**  
MEDIANO PLAZO GUBERNAMENTAL

**CALIFICACIÓN**  
AAA/3-F

**VaR Promedio**  
0.003%

**Límite de VaR**  
0.340%

**ACTIVOS NETOS**  
210,981,525.00

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