



**NAFMEX7 Fondo Líquido 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 | 23.58 |
| IM | BPAG28 | 171123 | mxAAA | 500,000 | 49,959,820.00 | 23.57 |
| LD | BONDESD | 180816 | HR AAA | 500,000 | 50,009,809.50 | 23.59 |
| LD | BONDESD | 180927 | HR AAA | 200,000 | 19,963,858.40 | 9.42 |
| TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA | | | | | 169,905,469.40 | 80.16 |
| TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR | | | | | 169,905,469.40 | 80.16 |
| OPERACIONES DE REPORTE | | | | | | |
| REPORTADO | | | | | | |
| LD | BONDESD | 180628 | HR AAA | 420,993 | 42,047,044.15 | 19.84 |
| TOTAL OPERACIONES DE REPORTE | | | | | 42,047,044.15 | 19.84 |
| TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES | | | | | 211,952,513.55 | 100.00 |

CATEGORIZACIÓN
MEDIANO PLAZO GUBERNAMENTAL

CALIFICACIÓN
AAA/3-F

VaR Promedio
0.004%

Límite de VaR
0.340%

ACTIVOS NETOS
211,951,017.83

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