

BONDDIA Fondo Diario Nafinsa, S. A. de C. V., Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda.
CARTERA DE VALORES AL 31 OCTUBRE, 2019

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
BI	CETES	191128	mxAAA	20,000,000	198,863,500.00	2.54
BI	CETES	191205	mxAAA	50,000,000	496,471,350.00	6.35
BI	CETES	200109	mxAAA	10,000,000	98,571,900.00	1.26
BI	CETES	200116	mxAAA	10,000,000	98,431,000.00	1.26
BI	CETES	200123	mxAAA	10,000,000	98,289,090.00	1.26
BI	CETES	200130	mxAAA	10,000,000	98,147,470.00	1.25
IM	BPAG28	210513	mxAAA	1,500,000	149,893,522.50	1.92
IM	BPAG28	211111	mxAAA	1,500,000	150,281,242.50	1.92
LD	BONDES	200702	mxAAA	737,000	73,813,025.58	0.94
LD	BONDES	200924	mxAAA	1,460,000	146,202,204.16	1.87
LD	BONDES	201126	mxAAA	1,500,000	149,958,111.00	1.92
LD	BONDES	201224	mxAAA	1,250,000	124,954,580.00	1.60
LD	BONDES	210121	mxAAA	1,493,809	149,322,880.46	1.91
LD	BONDES	210325	mxAAA	1,500,000	150,601,054.50	1.93
LD	BONDES	210520	mxAAA	1,500,000	150,580,402.50	1.93
LD	BONDES	210527	mxAAA	1,500,000	150,351,838.50	1.92
LD	BONDES	210722	mxAAA	1,500,000	150,337,069.50	1.92
LD	BONDES	210819	mxAAA	1,000,000	100,218,023.00	1.28
LD	BONDES	210915	mxAAA	1,203,307	120,580,713.50	1.54
LD	BONDES	211118	mxAAA	1,504,415	150,490,497.29	1.92
LD	BONDES	220113	mxAAA	1,500,000	150,015,969.00	1.92
LD	BONDES	220203	mxAAA	2,499,793	250,383,326.54	3.20
LD	BONDES	220317	mxAAA	1,000,000	99,841,286.00	1.28
LD	BONDES	220428	mxAAA	1,486,096	148,798,519.95	1.90
LD	BONDES	220512	mxAAA	1,000,000	99,833,096.00	1.28
LD	BONDES	220714	mxAAA	1,500,000	150,381,526.50	1.92
LD	BONDES	220721	mxAAA	1,503,635	150,487,148.42	1.92
LD	BONDES	220908	mxAAA	1,500,000	150,325,791.00	1.92
LD	BONDES	221013	mxAAA	1,000,000	100,046,710.00	1.28
LD	BONDES	221110	mxAAA	1,500,000	150,076,863.00	1.92
PAPEL PRIVADO						
95	FEFA	P17-3	mxAAA	2,000,000	202,177,450.00	2.58
95	FEFA	P17-4	mxAAA	1,200,000	121,107,046.80	1.55
95	FEFA	P17-5	mxAAA	1,000,000	100,787,464.00	1.29
95	FEFA	P18	mxAAA	930,000	93,696,090.12	1.20
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					4,974,317,762.32	63.60
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					4,974,317,762.32	63.60
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADO						
IQ	BPAG91	240502	mxAAA	4,391,499	446,500,443.12	5.71
IS	BPA182	240905	mxAAA	2,942,931	300,065,311.48	3.84
LD	BONDES	220113	mxAAA	2,008,401	200,043,337.49	2.56
LD	BONDES	230504	mxAAA	5,017,342	500,108,030.75	6.39
LD	BONDES	231101	mxAAA	2,003,412	200,043,280.95	2.56
LD	BONDES	240425	mxAAA	5,010,638	500,108,804.15	6.39
M	BONOS	240905	mxAAA	6,554,946	700,151,260.47	8.95
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					2,847,020,468.41	36.40
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					7,821,338,230.73	100.00

CATEGORIZACIÓN
MEDIANO PLAZO GUBERNAMENTAL

CALIFICACIÓN
AAA+/S4

VaR Promedio
0.005%

Límite de VaR
0.030%

ACTIVOS NETOS
7,812,524,218.81

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.