



**NAFFP28 Fondo de Rendimiento Nafinsa, S. A. de C. V., Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda.
CARTERA DE VALORES AL 23 SEPTIEMBRE, 2021**

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
BI	CETES	211007	mxAAA	500,000	4,991,815.00	2.62
BI	CETES	211104	mxAAA	1,000,000	9,946,485.00	5.22
BI	CETES	211216	mxAAA	2,000,000	19,775,286.00	10.39
BI	CETES	220113	mxAAA	1,500,000	14,770,573.50	7.76
BI	CETES	220602	mxAAA	500,000	4,821,535.00	2.53
IS	BPA182	220908	mxAAA	50,000	5,023,470.15	2.64
IS	BPA182	240307	mxAAA	50,000	5,038,344.70	2.65
LD	BONDESD	220908	mxAAA	70,000	7,006,829.90	3.68
LD	BONDESD	230105	mxAAA	100,000	9,996,645.80	5.25
LD	BONDESD	230309	mxAAA	172,377	17,209,397.42	9.04
LD	BONDESD	230504	mxAAA	100,000	9,981,000.40	5.24
LD	BONDESD	240425	mxAAA	50,000	4,985,466.10	2.62
LD	BONDESD	240822	mxAAA	50,000	4,976,707.10	2.61
LD	BONDESD	241024	mxAAA	170,000	16,961,208.21	8.91
S	UDIBONO	231116	mxAAA	6,972	5,067,000.61	2.66
PAPEL PRIVADO						
95	FEFA	P17-4	mxAAA	20,000	2,009,404.34	1.06
95	FEFA	P19-2	mxAAA	50,000	5,019,049.25	2.64
95	FEFA	P19-4	mxAAA	86,862	8,747,064.29	4.59
95	FEFA	P20	mxAAA	50,000	5,050,153.35	2.65
95	FEFA	P20-3	mxAAA	50,000	5,051,796.90	2.65
95	FEFA	20-3	mxAAA	70,000	7,008,998.36	3.68
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					173,438,231.38	91.10
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					173,438,231.38	91.10
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADOR						
LD	BONDESD	250220	mxAAA	169,873	16,941,614.59	8.90
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					16,941,614.59	8.90
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					190,379,845.97	100.00

CATEGORÍA
MEDIANO PLAZO GUBERNAMENTAL

CALIFICACIÓN
AAA/S4

VaR Promedio
0.007%

Límite de VaR
0.300%

ACTIVOS NETOS
190,265,907.78

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.