

BONDDIA Fondo Diario Nafinsa, S. A. de C. V., Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda.
CARTERA DE VALORES AL 31 AGOSTO, 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	210909	mxAAA	7,010,000	70,031,210.87	0.63
BI	CETES	211007	mxAAA	7,500,000	74,664,907.50	0.67
BI	CETES	211104	mxAAA	8,000,000	79,346,664.00	0.71
BI	CETES	211118	mxAAA	10,000,000	98,982,130.00	0.89
BI	CETES	211202	mxAAA	10,000,000	98,798,180.00	0.89
BI	CETES	211230	mxAAA	10,000,000	98,394,400.00	0.89
BI	CETES	220113	mxAAA	12,500,000	122,735,600.00	1.10
BI	CETES	220224	mxAAA	10,000,000	97,590,390.00	0.88
BI	CETES	220310	mxAAA	10,000,000	97,390,480.00	0.88
BI	CETES	220505	mxAAA	11,390,000	110,007,342.21	0.99
LD	BONDES	220714	mxAAA	2,500,000	250,409,457.50	2.25
LD	BONDES	220721	mxAAA	2,503,635	250,549,858.07	2.26
LD	BONDES	220908	mxAAA	2,500,000	250,368,920.00	2.25
LD	BONDES	221013	mxAAA	2,500,000	250,101,382.50	2.25
LD	BONDES	221110	mxAAA	2,500,000	255,067,243.50	2.30
LD	BONDES	230105	mxAAA	3,500,000	350,006,475.00	3.15
LD	BONDES	230309	mxAAA	2,500,000	249,710,897.50	2.25
LD	BONDES	230330	mxAAA	3,486,128	348,472,009.23	3.14
LD	BONDES	230504	mxAAA	3,400,000	339,513,201.60	3.06
LD	BONDES	230629	mxAAA	3,004,720	299,965,392.19	2.70
LD	BONDES	230706	mxAAA	2,500,000	250,208,665.00	2.25
LD	BONDES	230831	mxAAA	2,500,000	250,139,545.00	2.25
LD	BONDES	231101	mxAAA	2,300,000	229,857,275.80	2.07
LD	BONDES	231221	mxAAA	2,502,000	250,193,970.18	2.25
LD	BONDES	240201	mxAAA	3,000,000	299,380,023.00	2.69
LD	BONDES	240229	mxAAA	3,000,000	299,318,130.00	2.69
LD	BONDES	240404	mxAAA	2,000,000	199,323,964.00	1.79
LD	BONDES	240425	mxAAA	3,000,000	299,216,253.00	2.69
LD	BONDES	240530	mxAAA	3,000,000	298,889,826.00	2.69
LD	BONDES	240627	mxAAA	3,200,000	318,765,747.20	2.87
LD	BONDES	240822	mxAAA	2,600,000	258,896,305.20	2.33
LD	BONDES	241024	mxAAA	2,000,000	199,621,164.00	1.80
PAPEL PRIVADO						
95	FEFA	P17-4	mxAAA	1,380,000	138,760,544.22	1.25
95	FEFA	P17-5	mxAAA	2,500,000	250,837,020.00	2.26
95	FEFA	P18	mxAAA	1,220,000	122,312,953.18	1.10
95	FEFA	P19-4	mxAAA	1,500,000	151,093,701.00	1.36
95	FEFA	P20	mxAAA	1,500,000	156,618,269.75	1.41
95	FEFA	P20-3	mxAAA	1,500,000	151,611,337.50	1.36
95	FEFA	19-3	mxAAA	388,011	39,057,214.03	0.35
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					7,956,208,049.73	71.61
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					7,956,208,049.73	71.61
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADOR						
IS	BPA182	230309	mxAAA	3,483,401	360,046,159.17	3.24
LD	BONDES	231101	mxAAA	4,169,021	415,052,930.02	3.74
LD	BONDES	240801	mxAAA	4,808,031	480,059,993.38	4.32
LD	BONDES	240822	mxAAA	5,585,698	555,070,397.42	5.00
LD	BONDES	241024	mxAAA	3,607,402	360,045,486.33	3.24
LD	BONDES	250220	mxAAA	5,750,837	573,837,148.87	5.16
M	BONOS	240905	mxAAA	1,833,691	200,024,907.21	1.80
M	BONOS	240905	mxAAA	1,925,376	210,026,201.65	1.89
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					3,154,163,224.05	28.39
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					11,110,371,273.78	100.00

CATEGORÍA
MEDIANO PLAZO GUBERNAMENTAL

CALIFICACIÓN
AAA/S4

VaR Promedio

Límite de VaR

0.002%

0.030%

ACTIVOS NETOS
11,098,841,873.00

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.