



nacional financiera
OPERADORA DE FONDOS

**BONDDIA Fondo Diario Nafinsa, S. A. de C. V., Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda.
CARTERA DE VALORES AL 31 OCTUBRE, 2023**

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D						
LD				54,533,042	5,469,019,459.54	12.09
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF				155,571,909	15,590,766,050.09	34.48
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IM	BPAG28	260507	mxAAA	17,475,000	1,743,453,454.05	3.86
IM	BPAG28	241107	mxAAA	17,036,710	1,711,916,835.79	3.79
IM	BPAG28	240808	mxAAA	9,900,000	997,387,063.20	2.21
IM				19,500,000	1,953,991,836.00	4.32
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO TRIMESTRAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IQ				28,045,000	2,842,763,685.33	6.29
CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL						
95				11,074,356	1,120,373,893.34	2.48
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					31,429,672,277.34	69.50
REPORTO						
LF	BONDES F	261231	mxAAA	16,490,764	1,650,518,290.74	3.65
LF	BONDES F	261001	mxAAA	16,371,816	1,640,513,804.05	3.63
BI	CETES	250123	mxAAA	173,935,585	1,515,475,533.22	3.35
S	UDIBONO	401115	mxAAA	1,648,659	1,170,362,910.93	2.59
IM	BPAG28	231109	mxAAA	11,036,700	1,110,537,104.06	2.46
LF	BONDES F	270422	mxAAA	10,831,519	1,080,338,950.37	2.39
LF	BONDES F	271014	mxAAA	9,577,420	950,297,579.13	2.10
TOTAL REPORTO					9,118,044,172.50	20.16
OTROS VALORES				174,656,440	4,673,161,150.47	10.33
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					45,220,877,600.31	100.00

CATEGORÍA
MEDIANO PLAZO GUBERNAMENTAL

CALIFICACIÓN
AAAf/S4

VaR Promedio
0.007%

Límite de VaR
0.030%

ACTIVOS NETOS
44,513,190,779.21

Para el cálculo del VAR se utilizó el método histórico con un nivel de confianza del 95%, 500 observaciones y un horizonte de tiempo de un día.