

**BONDDIA Fondo Diario Nafinsa, S. A. de C. V., Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda.
CARTERA DE VALORES AL 16 NOVIEMBRE, 2023**

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D						
LD				53,133,042	5,320,654,299.89	11.53
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF				161,971,909	16,186,031,573.64	35.08
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IM	BPAG28	260507	mxAAA	17,475,000	1,752,308,822.93	3.80
IM	BPAG28	241107	mxAAA	17,036,710	1,705,712,440.81	3.70
IM	BPAG28	240808	mxAAA	9,900,000	994,056,109.20	2.15
IM				19,500,000	1,949,697,593.00	4.23
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO TRIMESTRAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IQ				32,370,000	3,250,036,924.86	7.04
CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL						
95				9,194,356	929,230,316.31	2.01
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					32,087,728,080.64	69.54
REPORTO						
S	UDIBONO	311127	mxAAA	2,287,196	1,570,486,807.16	3.40
LF	BONDES F	250619	mxAAA	15,412,445	1,540,482,017.31	3.34
M	BONOS	240905	mxAAA	14,218,787	1,410,440,160.52	3.06
IM	BPAG28	240808	mxAAA	11,838,773	1,188,703,123.74	2.58
LF	BONDES F	270930	mxAAA	9,571,299	950,297,095.71	2.06
TOTAL REPORTO					6,660,409,204.44	14.43
OTROS VALORES				173,116,685	7,396,546,395.25	16.03
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					46,144,683,680.33	100.00

CATEGORÍA
MEDIANO PLAZO GUBERNAMENTAL

CALIFICACIÓN
AAA/S4

VaR Promedio
0.005%

Límite de VaR
0.030%

ACTIVOS NETOS
45,946,614,452.65

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.