



nacional financiera
OPERADORA DE FONDOS

**NAFFP28 Fondo de Rendimiento 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	BONDES	241024	mxAAA	170,000	17,011,279.67	7.38
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDES	250619	mxAAA	350,000	35,135,304.75	15.24
LF	BONDES	251002	mxAAA	279,000	28,053,591.73	12.17
LF	BONDES	240425	mxAAA	100,000	10,056,888.40	4.36
LF	BONDES	241128	mxAAA	60,000	6,043,136.16	2.62
LF	BONDES	250102	mxAAA	50,000	5,023,183.55	2.18
LF	BONDES	250327	mxAAA	50,000	5,021,479.35	2.18
LF	BONDES	251023	mxAAA	50,000	4,993,808.35	2.17
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IM	BPAG28	240808	mxAAA	100,000	10,074,616.80	4.37
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO SEMESTRAL DE INTERÉS Y PROTECCIÓN CONTRA LA INFLACIÓN						
IS	BPA182	260219	mxAAA	50,000	5,091,412.35	2.21
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO TRIMESTRAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IQ	BPAG91	240502	mxAAA	50,000	5,139,414.65	2.23
IQ	BPAG91	240111	mxAAA	50,000	5,030,665.70	2.18
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL						
92	FONDO	00423	F1+(mex)	100,000	10,086,700.00	4.38
CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL						
95	FEFA	22-2	mxAAA	110,000	11,056,466.63	4.80
95	FEFA	P19-4	mxAAA	86,862	8,726,694.11	3.79
95	FEFA	P20-3	mxAAA	50,000	5,067,589.60	2.20
95	FEFA	P20	mxAAA	50,000	5,064,340.75	2.20
CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	241003	mxAAA	1,650,000	14,853,961.65	6.44
BI	CETES	240208	mxAAA	1,000,000	9,695,601.00	4.21
BI	CETES	240321	mxAAA	1,000,000	9,565,875.00	4.15
BI	CETES	241128	mxAAA	800,000	7,085,688.00	3.07
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					217,877,698.20	94.50
REPORTO						
IS	BPA182	260219	mxAAA	123,767	12,672,922.51	5.50
TOTAL REPORTO					12,672,922.51	5.50
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					230,550,620.71	100.00

CATEGORÍA
MEDIANO PLAZO GUBERNAMENTAL

CALIFICACIÓN
AAA/S4

VaR Promedio
0.031%

Límite de VaR
0.300%

ACTIVOS NETOS
230,961,443.92

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.