



NAFFP28 Fondo de Rendimiento Nafinsa, S. A. de C. V., Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda.
CARTERA DE VALORES AL 22 ENERO, 2026

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D						
LD	BONDESD	260611	mxAAA	100,000	9,999,100.30	3.96
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF				140,000	14,032,955.82	5.55
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IM	BPAG28	261105	mxAAA	384,729	38,623,107.05	15.28
IM	BPAG28	260806	mxAAA	310,000	30,989,936.47	12.26
IM	BPAG28	260507	mxAAA	300,000	30,038,515.50	11.89
IM	BPAG28	280803	mxAAA	180,000	17,916,001.92	7.09
IM	BPAG28	270805	mxAAA	100,000	9,977,989.50	3.95
IM	BPAG28	260205	mxAAA	60,000	6,017,382.36	2.38
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO TRIMESTRAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IQ	BPAG91	280907	mxAAA	300,000	30,149,921.10	11.93
IQ	BPAG91	290111	mxAAA	200,000	19,942,407.60	7.89
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL						
92	FONDO	00226	F1+(mex)	200,000	20,004,078.60	7.91
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					227,691,396.22	90.09
REPORTO						
LF	BONDES F	300321	mxAAA	251,330	25,046,906.34	9.91
TOTAL REPORTO					25,046,906.34	9.91
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					252,738,302.56	100.00

CATEGORÍA
MEDIANO PLAZO GUBERNAMENTAL

CALIFICACIÓN
AAAf/S3

VaR Promedio
0.002%

Límite de VaR
0.300%

ACTIVOS NETOS
252,604,875.62

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.