

NAFFP28 Fondo de Rendimiento Nafinsa, S. A. de C. V., Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda.
CARTERA DE VALORES AL 12 MARZO, 2026

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D						
LD	BONDES	260611	mxAAA	100,000	10,041,405.20	3.93
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDES	270617	mxAAA	100,000	10,018,816.40	3.92
LF				100,000	10,031,049.95	3.93
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IM	BPAG28	261105	mxAAA	384,729	38,569,349.25	15.10
IM	BPAG28	260806	mxAAA	310,000	31,122,994.98	12.18
IM	BPAG28	280803	mxAAA	180,000	18,001,999.98	7.05
IM	BPAG28	270805	mxAAA	100,000	10,022,291.10	3.92
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO TRIMESTRAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IQ	BPAG91	280907	mxAAA	300,000	29,895,234.60	11.70
IQ	BPAG91	290111	mxAAA	200,000	20,140,138.20	7.88
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL						
92	FONDO	00626	F1+(mex)	300,000	30,091,509.60	11.78
92	FONDO	00226	F1+(mex)	200,000	20,089,715.40	7.86
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					228,024,504.66	89.26
REPORTO						
LF	BONDES	290419	mxAAA	275,030	27,435,646.32	10.74
TOTAL REPORTO					27,435,646.32	10.74
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					255,460,150.98	100.00

CATEGORÍA
 MEDIANO PLAZO GUBERNAMENTAL

CALIFICACIÓN
 AAAf/S3

VaR Promedio
 0.002%

Límite de VaR
 0.300%

ACTIVOS NETOS
 255,232,015.87

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.