

**NAFFP28 Fondo de Rendimiento Nafinsa, S. A. de C. V., Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda.
CARTERA DE VALORES AL 31 agosto, 2016**

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
IM	BPAG28	170518	mxAAA	500,000	50,082,547.50	16.77
IM	BPAG28	171123	mxAAA	500,000	50,079,074.00	16.77
LD	BONDES	170427	HR AAA	300,000	30,032,565.60	10.06
LD	BONDES	180816	HR AAA	300,000	29,962,969.20	10.03
LD	BONDES	180927	HR AAA	300,000	30,006,229.80	10.05
TÍTULOS BANCARIOS						
CD	NAFR	190417	AAA(mex)	225,000	22,556,704.50	7.55
PAPEL PRIVADO						
95	CFE	14	Aa1.mx	100,000	9,818,948.30	3.29
95	FEFA	P16	AAA(mex)	200,000	20,130,716.00	6.74
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					242,669,754.90	81.26
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					242,669,754.90	81.26
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADO						
BI	CETES	160915	mxA-1+	5,604,825	55,954,910.28	18.74
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					55,954,910.28	18.74
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					298,624,665.18	100.00

CATEGORIZACIÓN
MEDIANO PLAZO GUBERNAMENTAL

CALIFICACIÓN
AAA/4-F

VaR Promedio

Límite de VaR

0.015%

0.340%

ACTIVOS NETOS
298,249,805.53

En el cálculo del VAR se utilizó el método paramétrico con un nivel de confianza del 95%, una muestra de un año de observaciones y un horizonte de tiempo de un día.