



**NAFGUBD Fondo Gubernamental Diario 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
<b>TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>						
<b>INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA</b>						
<b>VALORES GUBERNAMENTALES</b>						
LD	BONDESD	170223	HR AAA	200,000	20,041,750.60	32.97
LD	BONDESD	180816	HR AAA	100,000	9,987,656.40	16.43
LD	BONDESD	180927	HR AAA	200,000	20,004,153.20	32.91
<b>TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA</b>					50,033,560.20	82.32
<b>TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>					50,033,560.20	82.32
<b>OPERACIONES DE REPORTE</b>						
<b>REPORTADO</b>						
LD	BONDESD	180628	HR AAA	107,736	10,747,233.21	17.68
<b>TOTAL OPERACIONES DE REPORTE</b>					10,747,233.21	17.68
<b>TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES</b>					60,780,793.41	100.00

**CATEGORIZACIÓN**

MEDIANO PLAZO GUBERNAMENTAL

**CALIFICACIÓN**  
AAA/3-F

**VaR Promedio**

**Limite de VaR**

0.004%

0.050%

**ACTIVOS NETOS**

60,767,983.77

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.

\_\_\_\_\_  
Lic. Juan Manuel Pérez Porrúa