



**NAFMEX7 Fondo Líquido 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>						
IM	BPAG28	170518	mxAAA	500,000	50,082,547.50	23.80
IM	BPAG28	171123	mxAAA	500,000	50,079,074.00	23.80
LD	BONDESD	180816	HR AAA	500,000	49,938,282.00	23.73
LD	BONDESD	180927	HR AAA	200,000	20,004,153.20	9.51
<b>TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA</b>					170,104,056.70	80.84
<b>TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>					170,104,056.70	80.84
<b>OPERACIONES DE REPORTE</b>						
<b>REPORTADO</b>						
LD	BONDESD	180328	HR AAA	403,678	40,325,069.39	19.16
<b>TOTAL OPERACIONES DE REPORTE</b>					40,325,069.39	19.16
<b>TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES</b>					210,429,126.09	100.00

**CATEGORIZACIÓN**  
MEDIANO PLAZO GUBERNAMENTAL

**CALIFICACIÓN**  
AAA/3-F

**VaR Promedio**  
0.003%

**Límite de VaR**  
0.340%

**ACTIVOS NETOS**  
210,330,934.54

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