



**NAFG-LP Fondo Gubernamental de Largo Plazo Nafinsa, S.A. de C.V., Fondo de Inversión en Instrumento de Deuda.
CARTERA DE VALORES AL 22 septiembre, 2016**

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
LD	BONDES	191205	HR AAA	1,100,000	109,505,724.90	30.35
LD	BONDES	200528	HR AAA	500,000	49,687,301.50	13.77
M	BONOS	191211	Aaa.mx	250,000	24,878,336.00	6.90
M	BONOS	200611	HR AAA	200,000	21,998,719.80	6.10
M	BONOS	210610	HR AAA	605,000	63,320,327.90	17.55
M	BONOS	220609	Aaa.mx	100,000	10,497,924.90	2.91
M	BONOS	231207	Aaa.mx	80,000	9,165,530.72	2.54
M	BONOS	241205	HR AAA	100,000	12,915,388.20	3.58
M	BONOS	260305	HR AAA	60,000	5,882,365.74	1.63
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					307,851,619.66	85.33
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					307,851,619.66	85.33
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADO						
LD	BONDES	200402	HR AAA	301,850	30,003,454.23	8.32
LD	BONDES	200924	HR AAA	230,384	22,932,302.00	6.36
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					52,935,756.23	14.67
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					360,787,375.89	100.00

CATEGORIZACIÓN
LARGO PLAZO GUBERNAMENTAL

CALIFICACIÓN
AAA/5-F

VaR Promedio
0.121%

Límite de VaR
0.450%

ACTIVOS NETOS
360,697,867.21

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