

NAFMEX7 Fondo Líquido Nafinsa, S.A de C. V., Fondo de Inversión en Instrumentos 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						
IM	BPAG28	170518	mxAAA	500,000	50,052,979.00	23.74
IM	BPAG28	171123	mxAAA	500,000	50,049,110.50	23.74
LD	BONDESD	180816	HR AAA	500,000	49,913,460.50	23.67
LD	BONDESD	180927	HR AAA	200,000	19,991,883.60	9.48
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					170,007,433.60	80.63
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					170,007,433.60	80.63
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADO						
LD	BONDESD	180628	HR AAA	409,626	40,837,484.75	19.37
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					40,837,484.75	19.37
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					210,844,918.35	100.00

CATEGORIZACIÓN
MEDIANO PLAZO GUBERNAMENTAL

CALIFICACIÓN
AAA/3-F

VaR Promedio
0.004%

Límite de VaR
0.340%

ACTIVOS NETOS
210,782,952.79

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