

BONDDIA Fondo Diario 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						
LD	BONDESD	170622	HR AAA	689,449	68,965,867.52	5.40
LD	BONDESD	170824	HR AAA	700,000	69,944,305.20	5.47
LD	BONDESD	171019	HR AAA	693,615	69,290,445.39	5.42
LD	BONDESD	171221	HR AAA	770,121	77,102,790.22	6.03
LD	BONDESD	180215	HR AAA	939,869	94,066,490.93	7.36
LD	BONDESD	180419	HR AAA	700,000	69,974,220.40	5.48
LD	BONDESD	180628	HR AAA	950,000	94,775,809.50	7.42
LD	BONDESD	180816	HR AAA	700,000	69,878,844.70	5.47
LD	BONDESD	180927	HR AAA	555,789	55,556,344.97	4.35
LD	BONDESD	191205	HR AAA	500,000	49,775,329.50	3.90
LD	BONDESD	200402	HR AAA	700,000	69,579,386.80	5.45
TÍTULOS BANCARIOS						
F	BANSAN	15046	F1+(mex)	300,000	30,057,723.90	2.35
94	VWBANK	14	Aaa.mx	100,000	10,000,720.90	0.78
PAPEL PRIVADO						
95	FEFA	P16	AAA(mex)	1,950,000	196,848,717.00	15.41
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					1,025,816,996.93	80.29
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					1,025,816,996.93	80.29
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADO						
BI	CETES	170302	HR+1	5,097,914	50,005,902.19	3.91
LD	BONDESD	170223	HR AAA	2,015,743	201,863,172.21	15.80
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					251,869,074.40	19.71
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					1,277,686,071.33	100.00

CATEGORIZACIÓN

MEDIANO PLAZO GUBERNAMENTAL

CALIFICACIÓN
AAA/4-F

VaR Promedio

0.004%

Límite de VaR

0.030%

ACTIVOS NETOS

1,277,092,014.44

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.