



**NAFGUBD Fondo Gubernamental Diaria 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	170223	HR AAA	200,000	20,028,790.40	26.72
LD	BONDESD	180816	HR AAA	100,000	9,982,692.10	13.32
LD	BONDESD	180927	HR AAA	200,000	19,991,883.60	26.67
LD	BONDESD	191205	HR AAA	100,000	9,955,065.90	13.28
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					59,958,432.00	79.98
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					59,958,432.00	79.98
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADO						
LD	BONDESD	180628	HR AAA	150,524	15,006,424.29	20.02
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					15,006,424.29	20.02
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					74,964,856.29	100.00

CATEGORIZACIÓN
MEDIANO PLAZO GUBERNAMENTAL

CALIFICACIÓN
AAA/3-F

VaR Promedio
0.004%

Límite de VaR
0.050%

ACTIVOS NETOS
74,955,096.96

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