

**NAFG-LP Fondo Gubernamental de Largo Plazo Nafinsa, S.A. de C.V., Fondo de Inversión en Instrumento de Deuda.
CARTERA DE VALORES AL 31 julio, 2017**

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
IQ	BPAG91	200423	mxAAA	100,000	9,972,424.90	2.67
IQ	BPAG91	210422	mxAAA	100,000	9,959,960.10	2.67
LD	BONDESD	200924	mxAAA	300,000	30,013,968.00	8.05
LD	BONDESD	201126	mxAAA	500,000	49,941,930.50	13.39
LD	BONDESD	210121	mxAAA	600,000	59,910,959.40	16.06
LD	BONDESD	220317	mxAAA	300,000	29,896,423.50	8.02
M	BONOS	210610	mxAAA	605,000	60,535,243.07	16.23
M	BONOS	220609	mxAAA	200,000	19,961,070.40	5.35
M	BONOS	231207	mxAAA	80,000	8,589,359.44	2.30
M	BONOS	241205	mxAAA	260,000	31,119,875.28	8.34
M	BONOS	260305	mxAAA	70,000	6,663,240.15	1.79
M	BONOS	270603	mxAAA	100,000	10,553,690.70	2.83
S	UDIBONO	201210	mxAAA	17,687	10,033,409.66	2.69
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					337,151,555.10	90.39
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					337,151,555.10	90.39
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADO						
LD	BONDESD	200924	mxAAA	158,311	15,838,430.45	4.25
LD	BONDESD	220512	mxAAA	200,811	20,003,921.94	5.36
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					35,842,352.39	9.61
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					372,993,907.49	100.00

CATEGORIZACIÓN

LARGO PLAZO GUBERNAMENTAL

CALIFICACIÓN
AAA+/S5

VaR Promedio

0.200%

Límite de VaR

0.450%

ACTIVOS NETOS

372,892,673.58

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.