

**NAFGUBD Fondo Gubernamental Diario Nafinsa, S.A. de C.V., Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda.
CARTERA DE VALORES AL 31 mayo, 2017**

| Tipo Valor | Emisora | Serie | Calif. / Bursatilidad | Cant. Títulos | Valor Razonable | Participación Porcentual |
|--|---------|--------|-----------------------|---------------|-----------------|--------------------------|
| TÍTULOS PARA NEGOCIAR | | | | | | |
| INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA | | | | | | |
| VALORES GUBERNAMENTALES | | | | | | |
| LD | BONDESD | 171221 | HR AAA | 300,000 | 30,107,749.50 | 10.37 |
| LD | BONDESD | 180816 | HR AAA | 100,000 | 10,001,405.50 | 3.44 |
| LD | BONDESD | 180927 | HR AAA | 200,000 | 20,049,026.20 | 6.91 |
| LD | BONDESD | 190411 | HR AAA | 300,000 | 30,044,835.00 | 10.35 |
| LD | BONDESD | 190808 | HR AAA | 300,000 | 29,983,885.20 | 10.33 |
| LD | BONDESD | 191003 | Aaa.mx | 500,000 | 49,958,553.50 | 17.21 |
| LD | BONDESD | 191205 | HR AAA | 300,000 | 29,928,241.50 | 10.31 |
| S | UDIBONO | 190613 | Aaa.mx | 12,431 | 7,397,167.78 | 2.55 |
| TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA | | | | | 207,470,864.18 | 71.46 |
| TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR | | | | | 207,470,864.18 | 71.46 |
| OPERACIONES DE REPORTO | | | | | | |
| REPORTADO | | | | | | |
| LD | BONDESD | 180628 | HR AAA | 825,930 | 82,851,423.48 | 28.54 |
| TOTAL OPERACIONES DE REPORTO | | | | | 82,851,423.48 | 28.54 |
| TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES | | | | | 290,322,287.66 | 100.00 |

CATEGORIZACIÓN
MEDIANO PLAZO GUBERNAMENTAL

CALIFICACIÓN
AAA/3-F

VaR Promedio

Límite de VaR

0.025%

0.050%

ACTIVOS NETOS

290,276,534.85

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.