

**NAFGUBD Fondo Gubernamental Diario Nafinsa, S.A. de C.V., Fondo de Inversión en Instrumentos 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						
LD	BONDESD	171221	mxAAA	300,000	30,147,000.00	10.54
LD	BONDESD	180816	mxAAA	100,000	10,014,376.70	3.50
LD	BONDESD	180927	mxAAA	200,000	20,081,460.60	7.02
LD	BONDESD	190411	mxAAA	300,000	30,087,153.60	10.52
LD	BONDESD	190808	mxAAA	300,000	30,025,913.70	10.50
LD	BONDESD	191003	mxAAA	500,000	50,031,116.00	17.49
LD	BONDESD	191205	mxAAA	300,000	29,969,947.50	10.48
S	UDIBONO	190613	mxAAA	17,050	10,025,567.23	3.51
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					210,382,535.33	73.55
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					210,382,535.33	73.55
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADO						
LD	BONDESD	180628	mxAAA	757,092	75,651,678.51	26.45
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					75,651,678.51	26.45
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					286,034,213.84	100.00

CATEGORIZACIÓN
MEDIANO PLAZO GUBERNAMENTAL

CALIFICACIÓN
AAAf/S3

VaR Promedio

Límite de VaR

0.008%

0.050%

ACTIVOS NETOS

285,991,543.13

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.