

**NAFG-LP Fondo Gubernamental de Largo Plazo Nafinsa, S.A. de C.V., Fondo de Inversión en Instrumento de Deuda.
CARTERA DE VALORES AL 15 junio, 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	10,044,148.00	2.72
IQ	BPAG91	210422	mxAAA	100,000	10,029,332.60	2.72
LD	BONDESD	200924	mxAAA	300,000	29,893,259.70	8.09
LD	BONDESD	201126	mxAAA	500,000	49,735,386.00	13.47
LD	BONDESD	210121	mxAAA	600,000	59,661,867.60	16.15
LD	BONDESD	220317	mxAAA	300,000	29,764,205.40	8.06
M	BONOS	210610	mxAAA	605,000	59,628,171.41	16.14
M	BONOS	220609	mxAAA	100,000	9,825,253.70	2.66
M	BONOS	231207	mxAAA	80,000	8,447,357.20	2.29
M	BONOS	241205	mxAAA	260,000	30,652,316.76	8.30
M	BONOS	260305	mxAAA	70,000	6,558,269.55	1.78
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					304,239,567.92	82.38
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					304,239,567.92	82.38
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADO						
LD	BONDESD	200924	mxAAA	302,009	30,088,867.73	8.15
LD	BONDESD	220317	mxAAA	352,840	35,006,516.11	9.48
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					65,095,383.84	17.63
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					369,334,951.76	100.00

CATEGORIZACIÓN
LARGO PLAZO GUBERNAMENTAL

CALIFICACIÓN
AAAf/S5

VaR Promedio

Límite de VaR

0.170%

0.450%

ACTIVOS NETOS

369,307,868.48

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.