

**NAFGUBD Fondo Gubernamental Diario Nafinsa, S.A. de C.V., Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda.
CARTERA DE VALORES AL 10 agosto, 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	30,041,313.90	10.74
LD	BONDESD	180816	mxAAA	100,000	10,034,387.70	3.59
LD	BONDESD	180927	mxAAA	200,000	20,011,186.80	7.15
LD	BONDESD	190411	mxAAA	300,000	29,982,262.20	10.71
LD	BONDESD	190808	mxAAA	300,000	29,925,517.80	10.69
LD	BONDESD	191003	mxAAA	500,000	49,864,818.00	17.82
LD	BONDESD	191205	mxAAA	300,000	30,033,606.90	10.73
S	UDIBONO	190613	mxAAA	17,050	10,047,579.80	3.59
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					209,940,673.10	75.02
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					209,940,673.10	75.02
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADO						
LD	BONDESD	220714	mxAAA	701,190	69,890,104.65	24.98
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					69,890,104.65	24.98
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					279,830,777.75	100.00

CATEGORIZACIÓN
MEDIANO PLAZO GUBERNAMENTAL

CALIFICACIÓN
AAAf/S3

VaR Promedio

Límite de VaR

0.012%

0.050%

ACTIVOS NETOS

279,831,689.73

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.