

**BONDDIA Fondo Diario Nafinsa, S. A. de C. V., Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda.
 CARTERA DE VALORES AL 27 JUNIO, 2024**

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D						
LD				60,929,381	6,105,310,162.17	10.22
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDES F	260226	mxAAA	21,070,928	2,108,344,392.05	3.53
LF	BONDES F	261001	mxAAA	20,000,000	2,002,404,280.00	3.35
LF	BONDES F	260423	mxAAA	18,784,546	1,878,998,544.10	3.14
LF	BONDES F	260604	mxAAA	15,500,000	1,556,665,093.00	2.60
LF	BONDES F	261231	mxAAA	15,099,900	1,507,947,361.03	2.52
LF	BONDES F	261022	mxAAA	15,013,217	1,506,550,428.15	2.52
LF	BONDES F	261203	mxAAA	15,000,000	1,498,219,395.00	2.51
LF	BONDES F	270114	mxAAA	14,600,000	1,464,414,602.00	2.45
LF	BONDES F	260115	mxAAA	13,962,000	1,403,245,630.10	2.35
LF	BONDES F	251204	mxAAA	12,335,000	1,234,648,462.51	2.07
LF				154,425,369	15,448,206,155.82	25.85
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IM	BPAG28	260507	mxAAA	17,475,000	1,755,115,674.90	2.94
IM	BPAG28	241107	mxAAA	17,036,710	1,707,242,184.04	2.86
IM	BPAG28	260806	mxAAA	17,000,000	1,702,775,471.00	2.85
IM	BPAG28	261105	mxAAA	14,500,000	1,448,358,455.00	2.42
IM	BPAG28	260205	mxAAA	13,779,251	1,375,367,533.22	2.30
IM				41,200,000	4,125,889,554.90	6.90
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO TRIMESTRAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IQ				24,870,000	2,518,824,585.74	4.21
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					52,348,527,964.73	87.59
REPORTO						
LF	BONDES F	270520	mxAAA	14,170,785	1,410,431,556.03	2.36
LF	BONDES F	251204	mxAAA	12,809,467	1,280,391,723.25	2.14
TOTAL REPORTO					2,690,823,279.28	4.50
OTROS VALORES				85,287,492	4,726,343,949.17	7.91
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					59,765,695,193.18	100.00

CATEGORÍA
 MEDIANO PLAZO GUBERNAMENTAL

CALIFICACIÓN
 AAAf/S3

VaR Promedio
 0.002%

Límite de VaR
 0.030%

ACTIVOS NETOS
 59,733,424,371.68

Para el cálculo del VAR se utilizó el método histórico con un nivel de confianza del 95%, 500 observaciones y un horizonte de tiempo de un día.