

**NAFFP28 Fondo de Rendimiento 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 | BONDES | 251211 | mxAAA | 100,000 | 9,986,950.20 | 4.08 |
| LD | BONDES | 241024 | mxAAA | 70,000 | 7,045,549.91 | 2.88 |
| BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F | | | | | | |
| LF | BONDES | 251002 | mxAAA | 429,000 | 43,040,433.15 | 17.56 |
| LF | BONDES | 250619 | mxAAA | 350,000 | 35,057,736.35 | 14.31 |
| LF | BONDES | 260226 | mxAAA | 300,000 | 30,017,819.70 | 12.25 |
| LF | BONDES | 251204 | mxAAA | 165,000 | 16,515,362.49 | 6.74 |
| LF | BONDES | 260604 | mxAAA | 110,000 | 11,047,300.66 | 4.51 |
| LF | BONDES | 251023 | mxAAA | 50,000 | 5,026,677.65 | 2.05 |
| LF | BONDES | 250327 | mxAAA | 50,000 | 5,009,588.25 | 2.04 |
| BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL | | | | | | |
| IM | BPAG28 | 250807 | mxAAA | 200,000 | 20,064,485.40 | 8.19 |
| IM | BPAG28 | 260205 | mxAAA | 60,000 | 5,988,863.40 | 2.44 |
| BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO SEMESTRAL DE INTERÉS Y PROTECCIÓN CONTRA LA INFLACIÓN | | | | | | |
| IS | BPA182 | 260219 | mxAAA | 50,000 | 5,190,073.25 | 2.12 |
| CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL | | | | | | |
| 92 | FONDO | 00423 | F1+(mex) | 100,000 | 10,046,928.00 | 4.10 |
| CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL | | | | | | |
| 95 | FEFA | 22-2 | mxAAA | 110,000 | 11,013,524.39 | 4.49 |
| 95 | FEFA | P19-4 | mxAAA | 86,862 | 8,750,844.70 | 3.57 |
| 95 | FEFA | P20-3 | mxAAA | 50,000 | 5,032,808.85 | 2.05 |
| 95 | FEFA | P20 | mxAAA | 50,000 | 5,029,512.45 | 2.05 |
| TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO | | | | | 233,864,458.80 | 95.43 |
| REPORTO | | | | | | |
| IS | BPA182 | 260219 | mxAAA | 107,542 | 11,193,231.90 | 4.57 |
| TOTAL REPORTO | | | | | 11,193,231.90 | 4.57 |
| TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES | | | | | 245,057,690.70 | 100.00 |

CATEGORÍA
 MEDIANO PLAZO GUBERNAMENTAL

CALIFICACIÓN
 AAAf/S3

VaR Promedio
 0.004%

Límite de VaR
 0.300%

ACTIVOS NETOS
 244,962,098.45

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.