

**NAFM-EX Fondo de Conservación Patrimonial 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
<b>DIRECTO</b>						
<b>BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D</b>						
LD	BONDESD	250814	mxAAA	400,000	40,051,652.80	11.91
<b>BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F</b>						
LF	BONDES F	291004	mxAAA	303,510	30,169,985.73	8.97
<b>BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO SEMESTRAL DE INTERÉS Y PROTECCIÓN CONTRA LA INFLACIÓN</b>						
IS	BPA182	270401	mxAAA	500,000	51,152,236.50	15.22
IS	BPA182	270930	mxAAA	300,000	30,678,697.20	9.13
<b>BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO TRIMESTRAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL</b>						
IQ	BPAG91	290510	mxAAA	900,000	90,584,061.30	26.94
IQ	BPAG91	280511	mxAAA	500,000	50,434,896.00	15.00
<b>TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO</b>					<b>293,071,529.53</b>	<b>87.18</b>
<b>REPORTO</b>						
LF	BONDES F	310320	mxAAA	100,962	10,003,057.20	2.98
LF	BONDES F	261001	mxAAA	100,088	10,002,972.93	2.98
LG	BONDES G	300314	mxAAA	100,383	10,002,964.78	2.98
IQ	BPAG91	251231	mxAAA	87,169	8,953,798.89	2.66
<b>TOTAL REPORTO</b>					<b>38,962,793.80</b>	<b>11.59</b>
<b>OTROS VALORES</b>				41,363	<b>4,150,597.50</b>	<b>1.23</b>
<b>TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES</b>					<b>336,184,920.83</b>	<b>100.00</b>

**CATEGORÍA**  
 MEDIANO PLAZO GUBERNAMENTAL

**CALIFICACIÓN**  
 AAAf/S4

**VaR Promedio**  
 0.008%

**Límite de VaR**  
 0.300%

**ACTIVOS NETOS**  
 336,291,704.34

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.