

**NAFFP28 Fondo de Rendimiento Nafinsa, S. A. de C. V., Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda.
 CARTERA DE VALORES AL 28 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	9,996,236.50	4.07
LD	BONDES	241024	mxAAA	70,000	7,052,038.77	2.87
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDES	251002	mxAAA	429,000	43,080,386.78	17.56
LF	BONDES	250619	mxAAA	350,000	35,090,207.60	14.30
LF	BONDES	260226	mxAAA	300,000	30,045,710.70	12.25
LF	BONDES	251204	mxAAA	165,000	16,530,697.26	6.74
LF	BONDES	260604	mxAAA	110,000	11,057,590.39	4.51
LF	BONDES	251023	mxAAA	50,000	5,031,348.90	2.05
LF	BONDES	250327	mxAAA	50,000	5,014,223.25	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	20,083,052.80	8.19
IM	BPAG28	260205	mxAAA	60,000	5,994,414.06	2.44
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO SEMESTRAL DE INTERÉS Y PROTECCIÓN CONTRA LA INFLACIÓN						
IS	BPA182	260219	mxAAA	50,000	5,195,055.30	2.12
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL						
92	FONDO	00423	F1+(mex)	100,000	10,056,344.60	4.10
CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL						
95	FEFA	22-2	mxAAA	110,000	11,023,898.16	4.49
95	FEFA	P19-4	mxAAA	86,862	8,759,006.25	3.57
95	FEFA	P20-3	mxAAA	50,000	5,037,493.65	2.05
95	FEFA	P20	mxAAA	50,000	5,034,193.65	2.05
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					234,081,898.62	95.41
REPORTO						
IQ	BPAG91	270909	mxAAA	112,639	11,252,575.89	4.59
TOTAL REPORTO					11,252,575.89	4.59
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					245,334,474.51	100.00

CATEGORÍA
 MEDIANO PLAZO GUBERNAMENTAL

CALIFICACIÓN
 AAAf/S3

VaR Promedio
 0.004%

Límite de VaR
 0.300%

ACTIVOS NETOS
 245,221,016.26

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.