

**NAFM-EX Fondo de Conservación Patrimonial 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	BONDESD	250814	mxAAA	400,000	40,088,858.40	11.91
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDESF	291004	mxAAA	303,510	30,198,240.69	8.97
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO SEMESTRAL DE INTERÉS Y PROTECCIÓN CONTRA LA INFLACIÓN						
IS	BPA182	270401	mxAAA	500,000	51,203,003.50	15.22
IS	BPA182	270930	mxAAA	300,000	30,709,134.00	9.13
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO TRIMESTRAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IQ	BPAG91	290510	mxAAA	900,000	90,668,282.40	26.94
IQ	BPAG91	280511	mxAAA	500,000	50,481,642.50	15.00
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					293,349,161.49	87.18
REPORTO						
IQ	BPAG91	270909	mxAAA	131,389	13,125,690.87	3.90
LF	BONDESF	310320	mxAAA	100,931	10,009,237.14	2.97
IS	BPA182	260219	mxAAA	96,337	10,009,171.66	2.97
LF	BONDESF	250619	mxAAA	99,945	10,009,155.14	2.97
TOTAL REPORTO					43,153,254.81	12.82
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					336,502,416.30	100.00

CATEGORÍA
 MEDIANO PLAZO GUBERNAMENTAL

CALIFICACIÓN
 AAAf/S4

VaR Promedio
 0.008%

Límite de VaR
 0.300%

ACTIVOS NETOS
 336,594,410.86

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.