

**NAFFP28 Fondo de Rendimiento Nafinsa, S. A. de C. V., Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda.
 CARTERA DE VALORES AL 30 SEPTIEMBRE, 2024**

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D						
LD	BONDESD	251211	mxAAA	200,000	20,050,865.40	8.02
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDESF	260604	mxAAA	460,000	45,986,349.04	18.39
LF	BONDESF	251002	mxAAA	429,000	43,204,169.58	17.27
LF	BONDESF	260226	mxAAA	300,000	30,131,308.50	12.05
LF	BONDESF	251204	mxAAA	165,000	16,577,641.08	6.63
LF	BONDESF	250327	mxAAA	50,000	5,028,087.50	2.01
LF	BONDESF	261231	mxAAA	50,000	5,012,333.50	2.00
LF	BONDESF	251023	mxAAA	50,000	5,003,560.85	2.00
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO MENSUAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IM	BPAG28	250807	mxAAA	200,000	20,142,505.60	8.05
IM	BPAG28	260205	mxAAA	60,000	6,013,238.52	2.40
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO SEMESTRAL DE INTERÉS Y PROTECCIÓN CONTRA LA INFLACIÓN						
IS	BPA182	260219	mxAAA	50,000	5,062,522.05	2.02
CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL						
95	FEFA	22-2	mxAAA	110,000	11,047,101.01	4.42
95	FEFA	P20-3	mxAAA	50,000	5,045,766.25	2.02
95	FEFA	P20	mxAAA	50,000	5,042,437.85	2.02
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	241226	mxAAA	1,000,000	9,758,081.00	3.90
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					233,105,967.73	93.20
REPORTO						
LF	BONDESF	340323	mxAAA	171,804	16,994,324.82	6.80
TOTAL REPORTO					16,994,324.82	6.80
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					250,100,292.55	100.00

CATEGORÍA
 MEDIANO PLAZO GUBERNAMENTAL

CALIFICACIÓN
 AAAf/S3

VaR Promedio
 0.003%

Límite de VaR
 0.300%

ACTIVOS NETOS
 249,963,405.48

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.