

**NAFGUBD Fondo Gubernamental Diario Nafinsa, S.A. de C.V., Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda.
CARTERA DE VALORES AL 01 JUNIO, 2023**

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D						
LD	BONDES	240801	mxAAA	1,500,000	150,780,406.50	4.82
LD	BONDES	250619	mxAAA	1,500,000	149,821,278.00	4.79
LD	BONDES	241024	mxAAA	1,430,000	143,665,583.49	4.60
LD	BONDES	240627	mxAAA	1,005,064	100,386,382.29	3.21
LD	BONDES	240229	mxAAA	1,002,008	100,357,490.00	3.21
LD	BONDES	250416	mxAAA	1,000,000	100,164,745.00	3.20
LD	BONDES	231221	mxAAA	720,000	72,448,236.72	2.32
LD				2,315,340	231,552,826.17	7.41
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDES	261001	mxAAA	1,966,000	196,300,914.39	6.28
LF	BONDES	261203	mxAAA	1,500,000	149,377,857.00	4.78
LF	BONDES	250130	mxAAA	1,000,000	99,972,062.00	3.20
LF	BONDES	260226	mxAAA	1,000,000	99,762,997.00	3.19
LF				2,500,000	249,843,093.00	7.99
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO SEMESTRAL DE INTERÉS Y PROTECCIÓN CONTRA LA INFLACIÓN						
IS	BPA182	260219	mxAAA	750,000	77,335,279.50	2.47
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	230629	mxAAA	12,500,000	123,960,525.00	3.97
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					2,045,729,676.06	65.46
REPORTO						
LF	BONDES	251023	mxAAA	2,025,257	202,960,533.84	6.49
LF	BONDES	250227	mxAAA	2,001,537	200,062,079.05	6.40
IS	BPA182	260903	mxAAA	970,894	100,031,408.63	3.20
BI	CETES	230615	mxAAA	10,040,685	100,031,244.82	3.20
IQ	BPAG91	250904	mxAAA	976,258	100,031,194.78	3.20
S	UDIBONO	231116	mxAAA	107,962	82,483,465.15	2.64
TOTAL REPORTO					785,599,926.27	25.14
OTROS VALORES				2,932,877	294,048,638.74	9.41
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					3,125,378,241.07	100.00

CATEGORÍA
MEDIANO PLAZO GUBERNAMENTAL

CALIFICACIÓN
AAA/S3

VaR Promedio
0.008%

Límite de VaR
0.060%

ACTIVOS NETOS
3,124,710,828.68

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.