

**NAFM-EX Fondo de Conservación Patrimonial Nafinsa, S. A. de C. V., Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda.
CARTERA DE VALORES AL 30 DICIEMBRE, 2022**

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
BI	CETES	230309	mxAAA	2,618,900	25,701,646.28	1.26
BI	CETES	230601	mxAAA	5,000,000	47,836,880.00	2.35
BI	CETES	230629	mxAAA	5,000,000	47,449,235.00	2.33
IM	BPAG28	230209	mxAAA	500,000	50,238,639.50	2.46
IS	BPA182	240307	mxAAA	975,000	101,159,187.68	4.96
IS	BPA182	260219	mxAAA	400,000	41,168,728.80	2.02
IS	BPA182	270401	mxAAA	1,000,000	101,780,719.00	4.99
LD	BONDESD	240229	mxAAA	270,000	27,150,034.41	1.33
LD	BONDESD	240404	mxAAA	1,000,000	100,345,496.00	4.92
LD	BONDESD	240425	mxAAA	1,000,000	100,505,767.00	4.93
LD	BONDESD	240822	mxAAA	1,000,000	100,282,560.00	4.92
LD	BONDESD	241219	mxAAA	1,000,000	100,014,782.00	4.90
LD	BONDESD	250814	mxAAA	1,450,000	145,502,983.25	7.14
LF	BONDESF	240425	mxAAA	1,000,000	100,506,303.00	4.93
LF	BONDESF	241003	mxAAA	1,000,000	99,824,500.00	4.90
LF	BONDESF	250102	mxAAA	1,000,000	100,373,055.00	4.92
LF	BONDESF	250130	mxAAA	802,000	80,489,610.22	3.95
LF	BONDESF	250227	mxAAA	1,000,000	100,344,383.00	4.92
LF	BONDESF	250327	mxAAA	1,000,000	100,339,529.00	4.92
LF	BONDESF	250424	mxAAA	1,000,000	100,323,791.00	4.92
M	BONOS	241205	mxAAA	300,000	30,282,181.20	1.48
M	BONOS	250306	mxAAA	600,000	55,226,673.60	2.71
S	UDIBONO	231116	mxAAA	35,948	27,022,425.50	1.33
S	UDIBONO	251204	mxAAA	105,712	80,550,528.39	3.95
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					1,864,419,638.83	91.42
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADOR						
BI	CETES	241003	mxAAA	5,963,203	50,043,870.45	2.45
IQ	BPAG91	250430	mxAAA	1,226,964	124,829,008.55	6.12
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					174,872,879.00	8.58
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					2,039,292,517.83	100.00

CATEGORÍA
MEDIANO PLAZO GUBERNAMENTAL

CALIFICACIÓN
AAAf/S4

VaR Promedio
0.023%

Límite de VaR
0.300%

ACTIVOS NETOS
2,038,761,154.96

En el cálculo del VAR se utilizó el método paramétrico con un nivel de confianza del 95%, una muestra de un año de observaciones y un horizonte de tiempo de un día.