

**NAFGUBD Fondo Gubernamental Diario Nafinsa, S.A. de C.V., Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda.
CARTERA DE VALORES AL 31 MAYO, 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	150,731,530.50	4.27
LD	BONDES	250619	mxAAA	1,500,000	149,771,431.50	4.24
LD	BONDES	241024	mxAAA	1,430,000	143,618,815.34	4.07
LD	BONDES	240627	mxAAA	1,005,064	101,239,671.58	2.87
LD	BONDES	240229	mxAAA	1,002,008	100,324,816.53	2.84
LD	BONDES	250416	mxAAA	1,000,000	100,131,660.00	2.83
LD	BONDES	231221	mxAAA	720,000	72,424,895.76	2.05
LD				2,315,340	232,637,562.08	6.59
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDES	261001	mxAAA	1,966,000	196,233,266.29	5.56
LF	BONDES	261203	mxAAA	1,500,000	149,325,682.50	4.23
LF	BONDES	250130	mxAAA	1,000,000	99,938,836.00	2.83
LF	BONDES	260226	mxAAA	1,000,000	99,717,120.00	2.82
LF				2,500,000	250,193,227.50	7.08
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO SEMESTRAL DE INTERÉS Y PROTECCIÓN CONTRA LA INFLACIÓN						
IS	BPA182	260219	mxAAA	750,000	77,309,431.50	2.19
CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	230601	mxAAA	15,000,000	150,000,000.00	4.25
BI	CETES	230629	mxAAA	12,500,000	123,924,337.50	3.51
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					2,197,522,284.58	62.22
REPORTO						
LF	BONDES	251204	mxAAA	4,110,988	410,127,488.44	11.61
IS	BPA182	260219	mxAAA	1,425,711	147,778,134.94	4.18
IS	BPA182	280928	mxAAA	980,670	100,031,834.49	2.83
BI	CETES	230727	mxAAA	10,182,183	100,031,662.10	2.83
IQ	BPAG91	240829	mxAAA	973,123	100,031,582.43	2.83
M	BONOS	310529	mxAAA	1,000,000	97,706,272.08	2.77
TOTAL REPORTO					955,706,974.48	27.06
OTROS VALORES				3,767,108	378,826,765.05	10.73
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					3,532,056,024.11	100.00

**CATEGORÍA
MEDIANO PLAZO GUBERNAMENTAL**

CALIFICACIÓN
AAA+/S3

VaR Promedio
0.008%

Límite de VaR
0.060%

ACTIVOS NETOS
3,531,415,864.41

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.