

NAFINTR Fondo Estratégico Nafinsa, S. A. de C. V., Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda.
CARTERA DE VALORES AL 07 FEBRERO, 2019

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
S	UDIBONO	220609	mxAAA	138,985	81,214,000.11	5.48
PAPEL PRIVADO						
95	CDVITOT	11U	mxAAA	22,476	4,586,766.48	0.31
95	CDVITOT	12U	mxAAA	57,652	13,280,766.55	0.90
95	CDVITOT	12-2U	mxAAA	47,058	10,278,047.28	0.69
95	CDVITOT	13U	mxAAA	317,816	77,086,162.42	5.20
95	CDVITOT	14U	Aaa.mx	169,971	38,938,792.88	2.63
95	CDVITOT	14-2U	AA+(mex)	1,576	474,080.14	0.03
95	CDVITOT	15U	mxAAA	58,249	17,737,440.44	1.20
95	CEDEVIS	06U	mxAAA	129,899	6,147,401.46	0.42
95	CEDEVIS	07-3U	mxAAA	70,051	9,122,268.33	0.62
95	CEDEVIS	10-5U	mxAAA	35,810	4,956,321.04	0.33
95	CEDEVIS	11U	mxAAA	62,430	13,350,898.66	0.90
95	CEDEVIS	11-2U	mxAAA	99,600	18,758,061.02	1.27
95	CEDEVIS	12U	mxAAA	442,003	113,133,452.91	7.64
95	FOVISC	18U	Aaa.mx	6,886	3,866,872.61	0.26
95	TFOVICB	10-4U	mxAAA	549,033	61,903,524.01	4.18
95	TFOVICB	12-3U	mxAAA	124,472	25,971,420.37	1.75
95	TFOVICB	13U	mxAAA	148,360	41,790,445.52	2.82
95	TFOVICB	13-3U	mxAAA	514,642	137,114,824.68	9.26
95	TFOVICB	15U	mxAAA	19,843	8,497,828.15	0.57
95	TFOVIS	11-3U	mxAAA	1,798	188,592.09	0.01
95	TFOVIS	12-2U	mxAAA	100,162	14,831,921.65	1.00
95	TFOVIS	12-4U	mxAAA	185,720	42,573,646.40	2.87
95	TFOVIS	13-2U	mxAAA	156,413	32,745,054.51	2.21
95	TFOVIS	14U	Aaa.mx	626,364	218,729,949.23	14.77
95	TFOVIS	14-3U	mxAAA	307,803	107,821,692.44	7.28
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					1,105,100,231.38	74.60
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					1,105,100,231.38	74.60
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADO						
IS	BPA182	240905	mxAAA	1,020,413	106,206,212.08	7.17
LD	BONDESD	220113	mxAAA	1,199,024	120,027,419.53	8.10
LD	BONDESD	230706	mxAAA	1,503,864	150,034,238.76	10.13
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					376,267,870.37	25.40
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					1,481,368,101.75	100.00

CATEGORIZACIÓN
MEDIANO PLAZO

CALIFICACIÓN
AAA/S4

VaR Promedio

Límite de VaR

0.114%

1.980%

ACTIVOS NETOS

1,480,097,264.97

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.