

NAFINTR Fondo Estratégico Nafinsa, S. A. de C. V., Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda.
CARTERA DE VALORES AL 09 SEPTIEMBRE, 2021

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
S	UDIBONO	231116	mxAAA	217,578	157,556,147.25	8.30
2U	CBIC004	310116	mxAAA	2,987	2,678,239.04	0.14
2U	CBIC009	331124	mxAAA	41	31,858.63	0.00
TÍTULOS BANCARIOS						
95	TFOVIE	12U	Aaa.mx	9	9,127.98	0.00
PAPEL PRIVADO						
95	CDVITOT	11U	mxAAA	22,476	2,982,688.75	0.16
95	CDVITOT	12-2U	mxAAA	47,058	7,098,961.27	0.37
95	CDVITOT	13U	mxAAA	96,656	15,264,311.52	0.80
95	CDVITOT	14U	Aaa.mx	16,230	2,447,694.80	0.13
95	CDVITOT	14-2U	AA+(mex)	1,576	311,258.59	0.02
95	CDVITOT	15U	mxAAA	54,389	11,930,688.86	0.63
95	CEDEVIS	11U	mxAAA	113,701	11,067,829.87	0.58
95	CEDEVIS	12U	mxAAA	134,023	23,690,893.23	1.25
95	FOVISCB	17U	AAA(mex)	58,209	26,405,556.01	1.39
95	FOVISCB	18U	Aaa.mx	6,886	3,570,271.27	0.19
95	FOVISCB	19U	Aaa.mx	237,894	152,029,147.46	8.00
95	FOVISCB	19-2U	Aaa.mx	345,036	216,404,183.27	11.39
95	TFOVICB	12-3U	mxAAA	275,978	18,642,798.79	0.98
95	TFOVICB	13U	mxAAA	179,164	29,996,500.63	1.58
95	TFOVICB	13-3U	mxAAA	509,280	82,999,674.24	4.37
95	TFOVICB	15U	mxAAA	487,764	177,738,504.75	9.36
95	TFOVICB	15-2U	mxAAA	96,889	41,073,398.62	2.16
95	TFOVICB	16U	AAA(mex)	36,852	14,652,982.49	0.77
95	TFOVICB	20U	AAA(mex)	151,013	93,139,947.32	4.90
95	TFOVICB	20-2U	AAA(mex)	37,866	23,741,348.92	1.25
95	TFOVIS	12-4U	mxAAA	221,303	20,949,689.44	1.10
95	TFOVIS	13-2U	mxAAA	165,039	14,562,110.04	0.77
95	TFOVIS	14U	Aaa.mx	534,136	140,442,426.36	7.39
95	TFOVIS	14-2U	mxAAA	124,197	36,298,047.34	1.91
95	TFOVIS	14-3U	mxAAA	325,386	83,668,114.79	4.41
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					1,411,384,401.53	74.31
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					1,411,384,401.53	74.31
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADOR						
BI	CETES	211118	mxAAA	2,025,021	20,081,304.60	1.06
BI	CETES	211216	mxAAA	4,052,433	40,004,964.04	2.11
IQ	BPAG91	240502	mxAAA	499,997	50,006,194.11	2.63
IQ	BPAG91	250430	mxAAA	377,178	37,901,191.83	2.00
LD	BONDES	230629	mxAAA	1,000,000	99,933,795.13	5.26
LD	BONDES	240801	mxAAA	803,060	80,009,992.39	4.21
LD	BONDES	241219	mxAAA	1,203,641	120,015,019.17	6.32
S	UDIBONO	351122	mxAAA	49,633	40,004,735.92	2.11
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					487,957,197.19	25.69
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					1,899,341,598.72	100.00

CATEGORÍA
MEDIANO PLAZO

CALIFICACIÓN
AAA+/S4

VaR Promedio
0.219%

Límite de VaR
1.200%

ACTIVOS NETOS
1,898,030,512.36

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.