



**NAFCDVI Fondo en CEDEVIS Nafinsa, S. A. de C. V., Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda.  
CARTERA DE VALORES AL 30 septiembre, 2016**

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
<b>TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>						
<b>INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA</b>						
<b>PAPEL PRIVADO</b>						
95	CDVITOT	11U	mxAAA	129,973	38,728,816.58	0.43
95	CDVITOT	11-3U	mxAAA	518,600	134,502,056.86	1.50
95	CDVITOT	12U	mxAAA	766,814	221,519,547.93	2.47
95	CDVITOT	13U	mxAAA	982,044	336,695,859.48	3.75
95	CDVITOT	14U	AAA(mex)	1,065,341	370,054,145.92	4.12
95	CDVITOT	15U	mxAAA	663,999	292,253,286.78	3.26
95	CEDEVIS	06U	mxAAA	286,719	35,400,665.07	0.39
95	CEDEVIS	06-2U	mxAAA	610,465	75,244,195.61	0.84
95	CEDEVIS	06-3U	mxAAA	885,123	89,428,601.46	1.00
95	CEDEVIS	06-4U	mxAAA	773,550	69,271,160.38	0.77
95	CEDEVIS	07U	mxAAA	479,349	78,716,840.10	0.88
95	CEDEVIS	07-2U	mxAAA	1,091,282	205,079,932.66	2.29
95	CEDEVIS	07-3U	mxAAA	282,845	53,300,151.00	0.59
95	CEDEVIS	0810U	mxAAA	629,497	261,175,176.07	2.91
95	CEDEVIS	08-2U	mxAAA	609,363	237,734,041.80	2.65
95	CEDEVIS	08-6U	mxAAA	330,021	135,671,480.30	1.51
95	CEDEVIS	09U	mxAAA	479,334	96,338,150.69	1.07
95	CEDEVIS	09-2U	mxAAA	1,012,264	194,005,196.77	2.16
95	CEDEVIS	09-3U	mxAAA	903,969	170,031,335.82	1.89
95	CEDEVIS	09-4U	mxAAA	2,143,052	422,297,435.99	4.71
95	CEDEVIS	09-5U	mxAAA	796,541	168,822,861.53	1.88
95	CEDEVIS	10-2U	mxAAA	802,353	335,019,976.56	3.73
95	CEDEVIS	10-4U	mxAAA	1,065,017	517,651,755.67	5.77
95	CEDEVIS	10-5U	mxAAA	667,909	145,122,956.94	1.62
95	CEDEVIS	10-6U	mxAAA	1,999,837	488,741,832.29	5.45
95	CEDEVIS	11U	mxAAA	2,048,298	586,494,649.63	6.53
95	CEDEVIS	11-2U	mxAAA	2,644,979	795,805,128.63	8.87
95	CEDEVIS	12U	mxAAA	1,471,474	447,288,867.97	4.98
95	CEDEVIS	13U	AAA(mex)	695,316	202,391,982.61	2.26
<b>TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA</b>					<b>7,204,788,089.10</b>	<b>80.28</b>
<b>TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>					<b>7,204,788,089.10</b>	<b>80.28</b>
<b>OPERACIONES DE REPORTE</b>						
<b>REPORTADO</b>						
LD	BONDES	180628	HR AAA	1,781,967	177,523,849.84	1.98
LD	BONDES	190606	HR AAA	4,519,443	450,179,933.59	5.02
LD	BONDES	200130	mxAAA	3,017,282	300,121,227.20	3.34
LD	BONDES	200528	HR AAA	2,936,765	292,031,211.56	3.25
LD	BONDES	200924	HR AAA	1,007,123	100,040,095.31	1.11
M	BONOS	200611	HR AAA	4,087,999	450,182,588.96	5.02
<b>TOTAL OPERACIONES DE REPORTE</b>					<b>1,770,078,906.46</b>	<b>19.72</b>
<b>TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES</b>					<b>8,974,866,995.56</b>	<b>100.00</b>

**CATEGORIZACIÓN  
MEDIANO PLAZO**

**CALIFICACIÓN**  
AAA/5-F

**VaR Promedio**  
0.247%

**Límite de VaR**  
2.690%

**ACTIVOS NETOS**  
8,960,196,709.31

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.

Lic. Juan Manuel Pérez Porrúa