

NAFCDVI Fondo en CEDEVIS Nafinsa, S. A. de C. V., Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda.
CARTERA DE VALORES AL 06 octubre, 2016

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
PAPEL PRIVADO						
95	CDVITOT	11U	mxAAA	129,973	38,708,484.26	0.44
95	CDVITOT	11-3U	mxAAA	518,600	134,484,051.07	1.52
95	CDVITOT	12U	mxAAA	766,814	221,497,650.02	2.50
95	CDVITOT	13U	mxAAA	982,044	336,514,648.79	3.80
95	CDVITOT	14U	AAA(mex)	1,065,341	369,883,827.73	4.18
95	CDVITOT	15U	mxAAA	663,999	292,074,109.97	3.30
95	CEDEVIS	06U	mxAAA	286,719	35,382,699.83	0.40
95	CEDEVIS	06-2U	mxAAA	610,465	75,160,090.63	0.85
95	CEDEVIS	06-3U	mxAAA	885,123	89,432,815.53	1.01
95	CEDEVIS	06-4U	mxAAA	773,550	69,288,327.00	0.78
95	CEDEVIS	07U	mxAAA	479,349	78,626,407.55	0.89
95	CEDEVIS	07-2U	mxAAA	1,091,282	204,923,458.10	2.32
95	CEDEVIS	07-3U	mxAAA	282,845	53,253,228.43	0.60
95	CEDEVIS	0810U	mxAAA	629,497	261,063,936.40	2.95
95	CEDEVIS	08-2U	mxAAA	609,363	237,556,939.58	2.68
95	CEDEVIS	08-6U	mxAAA	330,021	135,489,412.00	1.53
95	CEDEVIS	09U	mxAAA	479,334	96,233,970.80	1.09
95	CEDEVIS	09-2U	mxAAA	1,012,264	193,723,886.58	2.19
95	CEDEVIS	09-3U	mxAAA	903,969	169,763,024.26	1.92
95	CEDEVIS	09-4U	mxAAA	2,143,052	422,108,300.94	4.77
95	CEDEVIS	09-5U	mxAAA	796,541	168,609,717.52	1.90
95	CEDEVIS	10-2U	mxAAA	802,353	334,851,032.31	3.78
95	CEDEVIS	10-4U	mxAAA	1,065,017	517,302,522.75	5.84
95	CEDEVIS	10-5U	mxAAA	667,909	145,043,979.37	1.64
95	CEDEVIS	10-6U	mxAAA	1,999,837	487,992,155.40	5.51
95	CEDEVIS	11U	mxAAA	2,048,298	585,875,953.03	6.62
95	CEDEVIS	11-2U	mxAAA	2,644,979	794,974,057.72	8.98
95	CEDEVIS	12U	mxAAA	1,471,474	446,873,869.63	5.05
95	CEDEVIS	13U	AAA(mex)	695,316	202,357,477.56	2.29
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					7,199,050,034.76	81.33
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					7,199,050,034.76	81.33
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADO						
IM	BPAG28	161020	mxAAA	466,580	46,739,005.18	0.53
IQ	BPAG91	180614	mxAAA	345,500	34,514,347.69	0.39
IQ	BPAG91	190822	mxAAA	1,188,683	118,772,894.45	1.34
LD	BONDES	190207	HR AAA	4,007,515	400,052,490.11	4.52
LD	BONDES	190328	HR AAA	1,585,771	158,375,593.65	1.79
LD	BONDES	200130	mxAAA	2,512,304	250,032,790.05	2.82
LD	BONDES	200528	HR AAA	2,453,423	244,096,582.10	2.76
LD	BONDES	200924	HR AAA	1,006,207	100,013,055.84	1.13
S	UDIBONO	171214	Aaa.mx	529,099	300,039,166.01	3.39
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					1,652,635,925.08	18.67
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					8,851,685,959.84	100.00

CATEGORIZACIÓN
MEDIANO PLAZO

CALIFICACIÓN
AAA/5-F

VaR Promedio
0.261%

Límite de VaR
2.690%

ACTIVOS NETOS
8,847,225,965.79

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.