

NAFINTR Fondo Estratégico 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
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
S	UDIBONO	220609	Aaa.mx	116,162	61,790,148.03	1.47
S	UDIBONO	251204	Aaa.mx	129,242	81,921,590.15	1.95
PAPEL PRIVADO						
95	CDVITOT	11-3U	mxAAA	41,160	10,675,095.76	0.25
95	CDVITOT	12U	mxAAA	235,451	68,017,797.12	1.62
95	CDVITOT	13U	mxAAA	305,257	104,658,007.15	2.50
95	CDVITOT	14U	AAA(mex)	358,301	124,458,525.99	2.97
95	CDVITOT	15U	mxAAA	183,549	80,787,468.86	1.93
95	CEDEVIS	06U	mxAAA	129,899	16,038,389.48	0.38
95	CEDEVIS	06-2U	mxAAA	81,650	10,063,948.91	0.24
95	CEDEVIS	06-3U	mxAAA	218,342	22,060,233.10	0.53
95	CEDEVIS	06-4U	mxAAA	307,512	27,537,603.35	0.66
95	CEDEVIS	07U	mxAAA	3,218	528,447.52	0.01
95	CEDEVIS	07-3U	mxAAA	103,206	19,448,444.85	0.46
95	CEDEVIS	0810U	mxAAA	240,001	99,575,221.86	2.38
95	CEDEVIS	08-2U	mxAAA	218,000	85,049,504.34	2.03
95	CEDEVIS	08-6U	mxAAA	52,923	21,756,620.80	0.52
95	CEDEVIS	09U	mxAAA	222,705	44,759,995.85	1.07
95	CEDEVIS	09-2U	mxAAA	104,714	20,068,934.76	0.48
95	CEDEVIS	10-2U	mxAAA	103,340	43,149,292.62	1.03
95	CEDEVIS	10-4U	mxAAA	353,181	171,663,705.58	4.09
95	CEDEVIS	10-5U	mxAAA	35,810	7,780,780.15	0.19
95	CEDEVIS	10-6U	mxAAA	635,429	155,293,023.26	3.70
95	CEDEVIS	11U	mxAAA	58,100	16,635,928.53	0.40
95	CEDEVIS	11-2U	mxAAA	62,686	18,860,580.86	0.45
95	CEDEVIS	12U	mxAAA	442,434	134,488,141.15	3.21
95	TFOVIS	10-2U	AAA(mex)	629,417	74,750,235.14	1.78
95	TFOVIS	10-3U	AAA(mex)	753,083	74,397,443.10	1.77
95	TFOVIS	10-4U	AAA(mex)	549,033	126,804,311.40	3.02
95	TFOVIS	11U	AAA(mex)	143,969	30,852,857.60	0.74
95	TFOVIS	11-2U	AAA(mex)	842,297	142,794,742.65	3.41
95	TFOVIS	12U	AAA(mex)	423,400	122,173,159.83	2.91
95	TFOVIS	12-2U	AAA(mex)	464,162	132,546,228.36	3.16
95	TFOVIS	12-3U	AAA(mex)	188,239	59,973,607.81	1.43
95	TFOVIS	12-4U	AAA(mex)	80,388	26,586,989.32	0.63
95	TFOVIS	13-2U	AAA(mex)	479,059	156,893,384.71	3.74
95	TFOVIS	13-3U	AAA(mex)	484,375	181,231,322.80	4.32
95	TFOVIS	14U	AAA(mex)	318,419	138,143,519.56	3.29
95	TFOVIS	14-3U	AAA(mex)	296,042	130,397,883.51	3.11
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					2,844,613,115.82	67.85
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					2,844,613,115.82	67.85
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADO						
IQ	BPAG91	180614	mxAAA	1,001,274	99,961,718.19	2.38
IS	BPA182	171005	mxAAA	690,088	70,481,165.02	1.68
IS	BPA182	180104	mxAAA	1,122,739	113,548,063.68	2.71
IS	BPA182	180412	mxAAA	2,581,508	263,589,454.95	6.29
LD	BONDESD	181011	HR AAA	1,002,167	100,119,722.29	2.39
LD	BONDESD	200130	mxAAA	2,514,401	250,100,956.35	5.97
LD	BONDESD	200924	HR AAA	1,007,123	100,040,095.31	2.39
M	BONOS	200611	HR AAA	3,179,555	350,142,038.11	8.35
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					1,347,983,213.90	32.15
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					4,192,596,329.72	100.00

CATEGORIZACIÓN
MEDIANO PLAZO

CALIFICACIÓN
AAA/5-F

VaR Promedio

Límite de VaR

0.188%

1.980%

ACTIVOS NETOS

4,187,647,803.16

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.