

NAFINTR Fondo Estratégico Nafinsa, S. A. de C. V., Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda.
CARTERA DE VALORES AL 31 OCTUBRE, 2019

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	22,476	4,613,318.86	0.37
95	CDVITOT	12U	mxAAA	58,674	12,307,298.29	0.99
95	CDVITOT	12-2U	mxAAA	47,058	10,520,887.18	0.85
95	CDVITOT	13U	mxAAA	80,396	16,959,606.55	1.36
95	CDVITOT	14-2U	AA+(mex)	1,576	477,238.93	0.04
95	CDVITOT	15U	mxAAA	58,249	15,802,741.73	1.27
95	CEDEVIS	07U	mxAAA	115,124	4,863,667.11	0.39
95	CEDEVIS	07-3U	mxAAA	70,051	6,558,728.51	0.53
95	CEDEVIS	10-5U	Aaa.mx	35,810	3,058,645.44	0.25
95	CEDEVIS	11U	mxAAA	113,701	18,887,490.51	1.52
95	CEDEVIS	11-2U	mxAAA	144,109	23,944,525.57	1.93
95	CEDEVIS	12U	mxAAA	297,158	71,074,344.94	5.71
95	FOVISC	17U	AAA(mex)	40,880	20,210,469.35	1.63
95	FOVISC	18U	Aaa.mx	6,886	3,820,493.03	0.31
95	FOVISC	19U	Aaa.mx	237,416	151,109,213.04	12.15
95	TFOVICB	10-4U	mxAAA	552,648	40,573,643.27	3.26
95	TFOVICB	12-3U	mxAAA	74,401	12,555,516.65	1.01
95	TFOVICB	13U	mxAAA	148,360	37,070,683.97	2.98
95	TFOVICB	13-3U	mxAAA	246,278	57,861,671.18	4.65
95	TFOVICB	15U	mxAAA	53,102	21,751,324.43	1.75
95	TFOVICB	15-2U	mxAAA	1,889	823,039.10	0.07
95	TFOVICB	16U	AAA(mex)	18,593	8,208,659.79	0.66
95	TFOVIS	11-3U	mxAAA	1,798	108,591.13	0.01
95	TFOVIS	12-2U	mxAAA	101,241	10,021,933.45	0.81
95	TFOVIS	12-4U	mxAAA	187,791	36,160,715.15	2.91
95	TFOVIS	13-2U	mxAAA	156,413	26,823,831.74	2.16
95	TFOVIS	14U	Aaa.mx	426,890	137,611,624.76	11.06
95	TFOVIS	14-3U	mxAAA	324,692	104,862,742.29	8.43
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					858,642,645.95	69.04
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					858,642,645.95	69.04
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADO						
IM	BPAG28	220210	mxAAA	363,359	36,328,460.98	2.92
IS	BPA182	240905	mxAAA	1,128,326	115,045,678.15	9.25
LD	BONDES	200528	mxAAA	500,000	50,154,171.60	4.03
LD	BONDES	220203	mxAAA	334,906	33,543,361.27	2.70
LD	BONDES	230831	mxAAA	1,508,539	150,032,634.41	12.06
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					385,104,306.41	30.96
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					1,243,746,952.36	100.00

CATEGORIZACIÓN
MEDIANO PLAZO

CALIFICACIÓN
AAA+/S4

VaR Promedio
0.097%

Límite de VaR
1.200%

ACTIVOS NETOS
1,241,473,050.34

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.