NAFINTR Fondo Estratégico Nafinsa, S. A. de C. V., Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda.
CARTERA DE VALORES AL 07 NOVIEMBRE, 2019

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
2U	CBIC009	331124	mxAAA	41	28,516.45	0.00
PAPEL PRIVADO						
95	CDVITOT	11U	mxAAA	22,476	4,619,343.17	0.37
95	CDVITOT	12U	mxAAA	58,674	12,318,855.90	0.99
95	CDVITOT	12-2U	mxAAA	47,058	10,547,081.92	0.85
95	CDVITOT	13U	mxAAA	80,396	16,980,559.51	1.37
95	CDVITOT	14-2U	AA+(mex)	1,576	477,947.93	0.04
95	CDVITOT	15U	mxAAA	58,249	15,821,501.17	1.27
95	CEDEVIS	07U	mxAAA	115,124	4,874,640.16	0.39
95	CEDEVIS	07-3U	mxAAA	70,051	6,568,454.88	0.53
95	CEDEVIS	10-5U	Aaa.mx	35,810	3,065,485.47	0.25
95	CEDEVIS	11U	mxAAA	113,701	18,905,428.54	1.52
95	CEDEVIS	11-2U	mxAAA	144,109	23,973,064.63	1.93
95	CEDEVIS	12U	mxAAA	297,158	71,142,759.92	5.72
95	FOVISCB	17U	AAA(mex)	40,880	20,165,756.77	1.62
95	FOVISCB	18U	Aaa.mx	6,886	3,820,715.73	0.31
95	FOVISCB	19U	Aaa.mx	237,416	151,094,219.98	12.15
95	TFOVICB	10-4U	mxAAA	552,648	40,682,277.28	3.27
95	TFOVICB	12-3U	mxAAA	74,401	12,581,444.06	1.01
95	TFOVICB	13U	mxAAA	152,385	38,136,286.42	3.07
95	TFOVICB	13-3U	mxAAA	246,278	57,980,131.88	4.66
95	TFOVICB	15U	mxAAA	60,157	24,753,782.67	1.99
95	TFOVICB	15-2U	mxAAA	1,889	824,212.29	0.07
95	TFOVICB	16U	AAA(mex)	18,593	8,223,101.70	0.66
95	TFOVIS	11-3U	mxAAA	1,798	108,829.63	0.01
95	TFOVIS	12-2U	mxAAA	101,241	10,043,162.48	0.81
95	TFOVIS	12-4U	mxAAA	187,791	36,232,603.99	2.91
95	TFOVIS	13-2U	mxAAA	156,413	26,877,956.11	2.16
95	TFOVIS	14U	Aaa.mx	426,890	137,832,638.95	11.09
95	TFOVIS	14-3U	mxAAA	324,692	105,035,986.90	8.45
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					863,716,746.49	69.48
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					863,716,746.49	69.48
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADO						
IM	BPAG28	200220	mxAAA	526,209	52,710,879.37	4.24
IS	BPA182	200730	mxAAA	659,045	67,315,015.75	5.41
IS	BPA182	240905	mxAAA	983,224	100,174,400.18	8.06
IS	BPA182	260219	mxAAA	90,164	9,229,730.29	0.74
LD	BONDESD	240822	mxAAA	1,505,070	150,032,651.47	12.07
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					379,462,677.06	30.52
TOTAL DE INVERSION EN VALORES					1,243,179,423.55	100.00

CATEGORÍA
MEDIANO PLAZO

CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
AAAf/S4	0.096%	1.200%

ACTIVOS NETOS
1,242,189,599.35

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. Luis Alberto Rico González