

NAFCDVI Fondo en CEDEVIS Nafinsa, S. A. de C. V., Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda.
CARTERA DE VALORES AL 31 DICIEMBRE, 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	263,773	54,879,071.26	1.33
95	CDVITOT	11-3U	mxAAA	394,711	59,160,621.96	1.44
95	CDVITOT	12U	mxAAA	521,767	110,669,628.50	2.69
95	CDVITOT	12-2U	mxAAA	245,731	49,343,986.42	1.20
95	CDVITOT	13U	mxAAA	1,542,068	329,575,875.66	8.01
95	CDVITOT	13-2U	mxAAA+	136,581	36,709,925.68	0.89
95	CDVITOT	14U	Aaa.mx	1,172,851	275,337,608.22	6.69
95	CDVITOT	14-2U	AA+(mex)	76,625	23,548,664.26	0.57
95	CDVITOT	15U	mxAAA	712,829	195,890,245.03	4.76
95	CDVITOT	15-2U	mxAAA+	58,201	20,870,583.99	0.51
95	CEDEVIS	07U	mxAAA	1,142,534	49,236,495.02	1.20
95	CEDEVIS	07-2U	mxAAA	575,082	57,064,594.97	1.39
95	CEDEVIS	0810U	mxAAA	914,494	88,495,820.32	2.15
95	CEDEVIS	08-2U	Aaa.mx	612,602	111,094,739.88	2.70
95	CEDEVIS	08-4U	Aaa.mx	24,049	6,824,685.05	0.17
95	CEDEVIS	08-6U	mxAAA	169,587	44,888,807.39	1.09
95	CEDEVIS	09-3U	mxAAA	903,969	46,246,654.49	1.12
95	CEDEVIS	09-4U	mxAAA	2,169,058	132,445,106.49	3.22
95	CEDEVIS	09-5U	mxAAA	504,681	21,303,759.91	0.52
95	CEDEVIS	10-2U	mxAAA	608,693	88,513,441.38	2.15
95	CEDEVIS	10-4U	Aaa.mx	944,732	150,601,016.73	3.66
95	CEDEVIS	10-5U	Aaa.mx	667,909	58,212,002.96	1.42
95	CEDEVIS	10-6U	mxAAA	2,400,444	158,637,463.30	3.86
95	CEDEVIS	11U	mxAAA	2,059,220	345,811,414.40	8.41
95	CEDEVIS	11-2U	mxAAA	2,127,497	285,850,182.05	6.95
95	CEDEVIS	12U	mxAAA	1,575,110	382,756,916.84	9.30
95	CEDEVIS	13U	Aaa.mx	90,384	19,669,526.15	0.48
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					3,203,638,838.31	77.87
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					3,203,638,838.31	77.87
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADOR						
IQ	BPAG91	240829	mxAAA	998,087	100,040,224.20	2.43
IS	BPA182	220908	mxAAA	531,197	54,828,475.74	1.33
IS	BPA182	260219	mxAAA	339,560	35,164,294.53	0.85
LD	BONDESD	200528	mxAAA	995,964	100,039,911.90	2.43
LD	BONDESD	210915	mxAAA	1,495,084	150,060,074.34	3.65
LD	BONDESD	220113	mxAAA	1,003,252	100,040,119.03	2.43
LD	BONDESD	230706	mxAAA	1,505,583	150,060,520.15	3.65
LD	BONDESD	231101	mxAAA	1,000,722	100,040,200.62	2.43
LD	BONDESD	240822	mxAAA	1,204,002	120,047,976.16	2.92
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					910,321,796.67	22.13
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					4,113,960,634.98	100.00

CATEGORÍA
MEDIANO PLAZO

CALIFICACIÓN
AAAt/S4

VaR Promedio
0.077%

Límite de VaR
2.690%

ACTIVOS NETOS
4,107,403,276.58

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.