

NAFINTR Fondo Estratégico 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						
VALORES GUBERNAMENTALES						
2U	CBIC009	331124	mxAAA	41	28,063.19	0.00
PAPEL PRIVADO						
95	CDVITOT	11U	mxAAA	22,476	4,676,225.41	0.39
95	CDVITOT	12U	mxAAA	58,674	12,445,075.64	1.03
95	CDVITOT	12-2U	mxAAA	47,058	9,449,476.51	0.78
95	CDVITOT	13U	mxAAA	80,396	17,182,499.15	1.42
95	CDVITOT	14-2U	AA+(mex)	1,576	484,341.86	0.04
95	CDVITOT	15U	mxAAA	58,249	16,007,220.36	1.32
95	CEDEVIS	07U	mxAAA	115,124	4,961,167.24	0.41
95	CEDEVIS	07-3U	mxAAA	70,051	6,653,433.96	0.55
95	CEDEVIS	10-5U	Aaa.mx	35,810	3,121,041.68	0.26
95	CEDEVIS	11U	mxAAA	113,701	19,094,173.34	1.58
95	CEDEVIS	11-2U	mxAAA	144,109	19,362,463.91	1.60
95	CEDEVIS	12U	mxAAA	297,158	72,210,372.54	5.96
95	FOVISC	17U	AAA(mex)	40,880	19,855,034.02	1.64
95	FOVISC	18U	Aaa.mx	6,886	3,756,512.91	0.31
95	FOVISC	19U	Aaa.mx	159,858	100,436,857.99	8.29
95	FOVISC	19-2U	Aaa.mx	78,593	50,139,308.96	4.14
95	TFOVIC	10-4U	mxAAA	552,648	35,419,410.38	2.92
95	TFOVIC	12-3U	mxAAA	74,401	11,877,711.63	0.98
95	TFOVIC	13U	mxAAA	152,385	36,926,584.65	3.05
95	TFOVIC	13-3U	mxAAA	246,278	55,868,993.52	4.61
95	TFOVIC	15U	mxAAA	60,157	24,407,564.70	2.02
95	TFOVIC	15-2U	mxAAA	1,889	814,866.90	0.07
95	TFOVIC	16U	AAA(mex)	18,593	8,053,583.76	0.67
95	TFOVIS	12-2U	mxAAA	101,241	8,851,336.62	0.73
95	TFOVIS	12-4U	mxAAA	187,791	34,503,305.59	2.85
95	TFOVIS	13-2U	mxAAA	156,413	25,453,865.64	2.10
95	TFOVIS	14U	Aaa.mx	349,490	110,459,778.64	9.12
95	TFOVIS	14-3U	mxAAA	324,692	102,677,931.06	8.48
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					815,178,201.76	67.31
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					815,178,201.76	67.31
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADOR						
BI	CETES	200408	mxAAA	5,097,982	50,019,995.10	4.13
IS	BPA182	200130	mxAAA	459,207	47,528,229.53	3.92
IS	BPA182	251002	mxAAA	738,224	75,713,215.31	6.25
LD	BONDES	210121	mxAAA	366,948	36,727,519.47	3.03
LD	BONDES	230706	mxAAA	1,505,583	150,060,520.15	12.39
LD	BONDES	231221	mxAAA	359,001	35,792,171.40	2.96
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					395,841,650.96	32.69
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					1,211,019,852.72	100.00

CATEGORÍA
MEDIANO PLAZO

CALIFICACIÓN
AAA+/S4

VaR Promedio
0.094%

Límite de VaR
1.200%

ACTIVOS NETOS
1,209,039,083.36

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