NAFINTR Fondo Estratégico Nafinsa, S. A. de C. V., Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda.
CARTERA DE VALORES AL 26 MARZO, 2020

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	27,962.24	0.00
PAPEL PRIVADO						
95	CDVITOT	11U	mxAAA	22,476	4,085,672.09	0.33
95	CDVITOT	12U	mxAAA	63,827	11,695,276.77	0.95
95	CDVITOT	12-2U	mxAAA	47,058	9,560,587.75	0.77
95	CDVITOT	13U	mxAAA	96,656	20,815,426.15	1.68
95	CDVITOT	14-2U	AA+(mex)	1,576	416,091.44	0.03
95	CDVITOT	15U	mxAAA	111,049	27,210,771.56	2.20
95	CEDEVIS	07U	mxAAA	115,124	5,099,697.56	0.41
95	CEDEVIS	07-3U	mxAAA	70,051	5,296,569.91	0.43
95	CEDEVIS	10-5U	AAA(mex)	35,810	2,187,655.17	0.18
95	CEDEVIS	11U	mxAAA	113,701	15,879,312.02	1.28
95	CEDEVIS	11-2U	mxAAA	144,109	19,711,123.53	1.59
95	CEDEVIS	12U	mxAAA	297,158	64,385,793.81	5.20
95	FOVISCB	17U	AAA(mex)	40,880	19,498,378.38	1.58
95	FOVISCB	18U	Aaa.mx	6,886	3,681,578.44	0.30
95	FOVISCB	19U	Aaa.mx	161,185	98,190,973.27	7.93
95	FOVISCB	19-2U	Aaa.mx	110,244	69,380,143.37	5.61
95	TFOVICB	12-3U	mxAAA	74,401	11,163,427.51	0.90
95	TFOVICB	13U	mxAAA	152,385	35,473,489.59	2.87
95	TFOVICB	13-3U	mxAAA	246,278	54,051,686.73	4.37
95	TFOVICB	15U	mxAAA	60,157	23,853,282.25	1.93
95	TFOVICB	15-2U	mxAAA	1,889	802,981.99	0.06
95	TFOVICB	16U	AAA(mex)	18,593	7,936,187.07	0.64
95	TFOVIS	12-2U	mxAAA	102,719	7,830,609.47	0.63
95	TFOVIS	12-4U	mxAAA	187,791	32,811,544.17	2.65
95	TFOVIS	13-2U	mxAAA	159,579	24,646,875.86	1.99
95	TFOVIS	14U	Aaa.mx	349,490	107,196,592.96	8.66
95	TFOVIS	14-3U	mxAAA	324,692	99,569,428.23	8.05
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					782,459,119.29	63.23
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					782,459,119.29	63.23
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADOR						
LD	BONDESD	210520	mxAAA	350,403	35,024,503.21	2.83
LD	BONDESD	231101	mxAAA	1,003,398	100,018,074.57	8.08
LD	BONDESD	240627	mxAAA	1,202,559	120,021,778.15	9.70
LD	BONDESD	250220	mxAAA	1,005,888	100,018,109.30	8.08
M	BONOS	211209	mxAAA	966,734	100,018,048.59	8.08
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					455,100,513.82	36.77
TOTAL DE INVERSION EN VALORES					1,237,559,633.11	100.00

CATEGORÍA
MEDIANO PLAZO

CALIFICACIÓN
AAAf/S4

VaR Promedio
0.109%

Límite de VaR
1.200%

ACTIVOS NETOS
1,235,570,943.10

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