



**NAFCDVI Fondo en CEDEVIS Nafinsa, S. A. de C. V., Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda.
CARTERA DE VALORES AL 23 SEPTIEMBRE, 2021**

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	414,441	55,229,373.31	1.50
95	CDVITOT	11-3U	mxAAA	660,014	71,052,529.38	1.93
95	CDVITOT	12U	mxAAA	751,733	6,641,441.53	0.18
95	CDVITOT	12-2U	mxAAA	272,358	41,291,814.26	1.12
95	CDVITOT	13U	mxAAA	2,041,473	323,653,651.39	8.80
95	CDVITOT	13-2U	mxAA+	249,712	50,421,597.83	1.37
95	CDVITOT	14U	Aaa.mx	1,981,650	300,072,968.28	8.15
95	CDVITOT	14-2U	AA+(mex)	193,352	38,346,557.83	1.04
95	CDVITOT	15U	mxAAA	1,542,867	289,316,316.91	7.86
95	CDVITOT	15-2U	mxAA+	74,280	17,949,218.57	0.49
95	CEDEVIS	08-2U	Aaa.mx	642,970	59,685,647.45	1.62
95	CEDEVIS	08-4U	Aaa.mx	495,699	98,162,592.87	2.67
95	CEDEVIS	08-6U	mxAAA	1,080,570	159,627,782.44	4.34
95	CEDEVIS	11U	mxAAA	2,520,219	169,682,998.42	4.61
95	CEDEVIS	11-2U	mxAAA	3,520,063	197,877,507.89	5.38
95	CEDEVIS	12U	mxAAA	2,426,241	430,712,838.61	11.70
95	CEDEVIS	13U	Aaa.mx	508,555	79,509,830.60	2.16
95	HITOTAL	10U	Aaa.mx	1,664,956	120,228,167.69	3.27
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					2,509,462,835.26	68.20
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					2,509,462,835.26	68.20
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADOR						
BI	CETES	211021	mxAAA	12,042,774	120,015,059.98	3.26
IQ	BPAG91	211223	mxAAA	1,503,264	150,018,774.84	4.08
IS	BPA182	260219	mxAAA	2,010,690	200,025,267.78	5.44
IS	BPA182	270121	mxAAA	1,186,757	120,230,519.87	3.27
LD	BONDES	220519	mxAAA	202,277	20,253,219.96	0.55
LD	BONDES	230105	mxAAA	1,200,587	120,015,392.50	3.26
LD	BONDES	230629	mxAAA	1,000,000	99,762,103.71	2.71
LD	BONDES	230706	mxAAA	1,199,562	120,014,906.55	3.26
LD	BONDES	231101	mxAAA	1,003,802	100,012,627.84	2.72
LD	BONDES	250220	mxAAA	1,206,716	120,015,401.40	3.26
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					1,170,363,274.43	31.80
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					3,679,826,109.69	100.00

CATEGORÍA
MEDIANO PLAZO

CALIFICACIÓN
AAA/S4

Var Promedio
0.117%

Límite de Var
2.690%

ACTIVOS NETOS
3,671,398,186.40

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.