

NAFINTR Fondo Estratégico 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						
VALORES GUBERNAMENTALES						
S	UDIBONO	231116	mxAAA	217,578	158,127,920.04	8.38
S	UDIBONO	251204	mxAAA	51,913	39,936,102.82	2.12
2U	CBIC004	310116	mxAAA	2,987	2,668,840.18	0.14
2U	CBIC009	331124	mxAAA	41	32,042.59	0.00
TÍTULOS BANCARIOS						
95	TFOVIE	12U	Aaa.mx	9	9,144.74	0.00
PAPEL PRIVADO						
95	CDVITOT	11U	mxAAA	22,476	2,995,204.13	0.16
95	CDVITOT	12-2U	mxAAA	47,058	7,134,397.36	0.38
95	CDVITOT	13U	mxAAA	96,656	15,323,772.26	0.81
95	CDVITOT	14U	Aaa.mx	16,230	2,457,640.99	0.13
95	CDVITOT	14-2U	AA+(mex)	1,576	312,560.38	0.02
95	CDVITOT	15U	mxAAA	54,389	10,198,951.15	0.54
95	CEDEVIS	11U	mxAAA	113,701	7,655,337.34	0.41
95	CEDEVIS	12U	mxAAA	134,023	23,792,124.02	1.26
95	FOVISCB	17U	AAA(mex)	58,209	26,279,387.07	1.39
95	FOVISCB	18U	Aaa.mx	6,886	3,552,003.91	0.19
95	FOVISCB	19U	Aaa.mx	237,894	151,727,290.42	8.04
95	FOVISCB	19-2U	Aaa.mx	345,036	215,294,421.56	11.41
95	TFOVICB	12-3U	mxAAA	275,978	18,691,944.96	0.99
95	TFOVICB	13U	mxAAA	179,164	30,138,493.47	1.60
95	TFOVICB	13-3U	mxAAA	509,280	83,299,441.03	4.42
95	TFOVICB	15U	mxAAA	487,764	178,521,541.57	9.47
95	TFOVICB	15-2U	mxAAA	96,889	40,937,590.47	2.17
95	TFOVICB	16U	AAA(mex)	36,852	14,610,679.97	0.77
95	TFOVICB	20U	AAA(mex)	151,013	92,956,131.58	4.93
95	TFOVICB	20-2U	AAA(mex)	37,866	23,615,858.00	1.25
95	TFOVIS	12-4U	mxAAA	221,303	21,036,083.25	1.12
95	TFOVIS	13-2U	mxAAA	165,039	14,619,380.06	0.78
95	TFOVIS	14U	Aaa.mx	534,136	140,974,046.04	7.47
95	TFOVIS	14-2U	mxAAA	124,197	36,422,417.72	1.93
95	TFOVIS	14-3U	mxAAA	325,386	84,094,256.57	4.46
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					1,447,415,005.65	76.74
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					1,447,415,005.65	76.74
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADOR						
BI	CETES	211021	mxAAA	5,017,822	50,006,270.01	2.65
BI	CETES	211209	mxAAA	10,000,000	98,997,387.85	5.25
IQ	BPAG91	221229	mxAAA	495,923	50,006,228.45	2.65
IS	BPA182	260219	mxAAA	1,206,414	120,015,160.67	6.36
IS	BPA182	270121	mxAAA	184,182	18,659,504.52	0.99
LD	BONDESD	230105	mxAAA	800,391	80,010,228.34	4.24
LD	BONDESD	230309	mxAAA	210,593	21,017,852.25	1.11
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					438,712,632.09	23.26
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					1,886,127,637.74	100.00

CATEGORÍA
MEDIANO PLAZO

CALIFICACIÓN
AAA/S4

VaR Promedio

Límite de VaR

0.222%

1.200%

ACTIVOS NETOS
1,884,503,879.06

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.