



**NAFCDVI Fondo en CEDEVIS Nafinsa, S. A. de C. V., Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda.  
CARTERA DE VALORES AL 31 AGOSTO, 2021**

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
<b>TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>						
<b>INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA</b>						
<b>PAPEL PRIVADO</b>						
95	CDVITOT	11U	mxAAA	414,441	55,147,067.81	1.46
95	CDVITOT	11-3U	mxAAA	660,014	70,659,528.67	1.87
95	CDVITOT	12U	mxAAA	751,733	125,139,505.58	3.32
95	CDVITOT	12-2U	mxAAA	272,358	41,010,273.71	1.09
95	CDVITOT	13U	mxAAA	2,041,473	322,932,741.95	8.56
95	CDVITOT	13-2U	mxAA+	249,712	50,260,288.37	1.33
95	CDVITOT	14U	Aaa.mx	1,981,650	299,637,843.51	7.94
95	CDVITOT	14-2U	AA+(mex)	193,352	38,282,093.69	1.01
95	CDVITOT	15U	mxAAA	1,542,867	339,469,086.42	9.00
95	CDVITOT	15-2U	mxAA+	74,280	21,132,574.36	0.56
95	CEDEVIS	08-2U	Aaa.mx	642,970	59,448,690.50	1.58
95	CEDEVIS	08-4U	Aaa.mx	495,699	97,533,365.94	2.59
95	CEDEVIS	08-6U	mxAAA	1,080,570	158,793,274.43	4.21
95	CEDEVIS	11U	mxAAA	2,520,219	245,258,315.18	6.50
95	CEDEVIS	11-2U	mxAAA	3,520,063	197,229,084.13	5.23
95	CEDEVIS	12U	mxAAA	2,426,241	430,022,944.26	11.40
95	CEDEVIS	13U	Aaa.mx	508,534	79,392,928.66	2.10
95	HITOTAL	10U	Aaa.mx	1,761,770	127,714,304.83	3.39
<b>TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA</b>					<b>2,759,063,912.00</b>	<b>73.15</b>
<b>TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>					<b>2,759,063,912.00</b>	<b>73.15</b>
<b>OPERACIONES DE REPORTE</b>						
<b>REPORTADOR</b>						
BI	CETES	211202	mxAAA	5,643,082	55,864,404.33	1.48
BI	CETES	220113	mxAAA	10,000,000	98,352,834.33	2.61
IQ	BPAG91	250102	mxAAA	215,758	21,662,246.71	0.57
IS	BPA182	260903	mxAAA	357,570	36,877,993.87	0.98
LD	BONDES	211118	mxAAA	1,199,426	120,014,933.68	3.18
LD	BONDES	231101	mxAAA	803,666	80,010,133.81	2.12
LD	BONDES	240229	mxAAA	602,168	60,007,518.14	1.59
LD	BONDES	241024	mxAAA	1,202,467	120,015,128.84	3.18
LD	BONDES	241219	mxAAA	1,801,293	180,022,992.78	4.77
LD	BONDES	251211	mxAAA	1,208,694	120,015,391.24	3.18
LD	BONDES	251211	mxAAA	1,208,694	120,014,991.24	3.18
<b>TOTAL OPERACIONES DE REPORTE</b>					<b>1,012,858,568.97</b>	<b>26.85</b>
<b>TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES</b>					<b>3,771,922,480.97</b>	<b>100.00</b>

**CATEGORÍA  
MEDIANO PLAZO**

**CALIFICACIÓN**  
AAA/S4

**VaR Promedio**

**Límite de VaR**

0.125%

2.690%

**ACTIVOS NETOS**  
3,766,557,393.04

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.