

NAFINTR Fondo Estratégico 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
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
S	UDIBONO	231116	mxAAA	176,250	127,971,810.27	6.71
2U	CBIC004	310116	mxAAA	2,987	2,664,825.64	0.14
2U	CBIC009	331124	mxAAA	41	31,996.70	0.00
TÍTULOS BANCARIOS						
95	TFOVIE	12U	Aaa.mx	9	9,127.85	0.00
PAPEL PRIVADO						
95	CDVITOT	11U	mxAAA	22,476	2,990,740.53	0.16
95	CDVITOT	12-2U	mxAAA	47,058	7,085,752.80	0.37
95	CDVITOT	13U	mxAAA	96,656	15,289,639.93	0.80
95	CDVITOT	14U	Aaa.mx	16,230	2,454,077.26	0.13
95	CDVITOT	14-2U	AA+(mex)	1,576	312,034.94	0.02
95	CDVITOT	15U	mxAAA	54,389	11,966,931.78	0.63
95	CEDEVIS	11U	mxAAA	113,701	11,064,957.33	0.58
95	CEDEVIS	12U	mxAAA	134,023	23,754,014.98	1.25
95	FOVISC	17U	AAA(mex)	58,209	26,303,969.78	1.38
95	FOVISC	18U	Aaa.mx	6,886	3,556,032.46	0.19
95	FOVISC	19U	Aaa.mx	237,894	150,891,865.46	7.91
95	FOVISC	19-2U	Aaa.mx	345,036	215,612,164.52	11.30
95	TFOVIC	12-3U	mxAAA	275,978	18,632,819.43	0.98
95	TFOVIC	13U	mxAAA	178,762	29,878,399.38	1.57
95	TFOVIC	13-3U	mxAAA	509,280	82,910,798.77	4.35
95	TFOVIC	15U	mxAAA	487,764	178,143,945.90	9.34
95	TFOVIC	15-2U	mxAAA	96,889	40,941,278.74	2.15
95	TFOVIC	16U	AAA(mex)	36,852	14,606,849.69	0.77
95	TFOVIC	20U	AAA(mex)	151,013	92,427,581.10	4.85
95	TFOVIC	20-2U	AAA(mex)	37,866	23,645,012.40	1.24
95	TFOVIS	12-4U	mxAAA	221,303	20,919,900.28	1.10
95	TFOVIS	13-2U	mxAAA	165,039	14,557,578.90	0.76
95	TFOVIS	14U	Aaa.mx	534,136	140,650,371.38	7.37
95	TFOVIS	14-2U	mxAAA	124,197	36,359,545.35	1.91
95	TFOVIS	14-3U	mxAAA	325,386	83,509,919.60	4.38
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					1,379,143,943.15	72.31
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					1,379,143,943.15	72.31
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADOR						
BI	CETES	211202	mxAAA	4,428,826	43,843,723.41	2.30
IS	BPA182	260903	mxAAA	138,545	14,222,621.70	0.75
LD	BONDES	220714	mxAAA	1,198,375	120,015,159.30	6.29
LD	BONDES	241024	mxAAA	1,202,467	120,015,128.84	6.29
LD	BONDES	241219	mxAAA	1,501,077	150,019,110.68	7.87
LD	BONDES	251211	mxAAA	805,796	80,010,260.83	4.20
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					528,126,004.76	27.69
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					1,907,269,947.91	100.00

CATEGORÍA
MEDIANO PLAZO

CALIFICACIÓN
AAA/S4

VaR Promedio

Límite de VaR

0.216%

1.200%

ACTIVOS NETOS
1,895,443,852.90

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.