



**NAFM-EX Fondo de Conservación Patrimonial 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						
BI	CETES	211007	mxAAA	5,000,000	49,776,605.00	4.08
BI	CETES	211216	mxAAA	2,531,200	24,957,454.82	2.05
BI	CETES	220113	mxAAA	3,000,000	29,456,544.00	2.42
BI	CETES	220224	mxAAA	2,500,000	24,397,597.50	2.00
BI	CETES	221006	mxAAA	5,000,000	47,126,645.00	3.87
IS	BPA182	240307	mxAAA	1,475,000	152,247,216.70	12.49
IS	BPA182	270401	mxAAA	1,000,000	101,039,606.00	8.29
LD	BONDESD	220908	mxAAA	1,000,000	100,147,568.00	8.22
LD	BONDESD	221110	mxAAA	2,000,000	200,052,740.00	16.42
LD	BONDESD	230309	mxAAA	1,150,000	114,867,012.85	9.43
LD	BONDESD	230706	mxAAA	2,000,000	200,166,932.00	16.43
LD	BONDESD	230831	mxAAA	500,000	50,027,909.00	4.11
S	UDIBONO	231116	mxAAA	69,811	50,688,454.16	4.16
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					1,144,952,285.03	93.96
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					1,144,952,285.03	93.96
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADOR						
LD	BONDESD	231101	mxAAA	351,604	35,004,445.99	2.87
LD	BONDESD	241219	mxAAA	386,647	38,641,881.18	3.17
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					73,646,327.17	6.04
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					1,218,598,612.20	100.00

CATEGORÍA
MEDIANO PLAZO GUBERNAMENTAL

CALIFICACIÓN
AAA/S4

VaR Promedio
0.010%

Límite de VaR
0.300%

ACTIVOS NETOS
1,218,587,003.54

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