

NAFCDVI Fondo en CEDEVIS Nafinsa, S. A. de C. V., Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda.
CARTERA DE VALORES AL 15 junio, 2017

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN						
CHM	BINTER	0194891		201,186,031	201,226,197.35	2.58
TOTAL DISPONIBILIDADES					201,226,197.35	2.58
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
PAPEL PRIVADO						
95	CDVITOT	11U	mxAAA	184,714	51,629,305.41	0.66
95	CDVITOT	11-3U	mxAAA	518,600	122,175,909.31	1.57
95	CDVITOT	12U	mxAAA	766,814	210,590,330.49	2.70
95	CDVITOT	13U	mxAAA	982,044	287,430,219.86	3.69
95	CDVITOT	14U	Aaa.mx	1,495,341	460,150,419.29	5.90
95	CDVITOT	15U	mxAAA	759,538	304,925,513.16	3.91
95	CEDEVIS	06U	mxAAA	286,719	26,422,408.53	0.34
95	CEDEVIS	06-2U	mxAAA	610,465	66,583,978.57	0.85
95	CEDEVIS	07U	mxAAA	479,349	62,202,638.14	0.80
95	CEDEVIS	07-2U	mxAAA	1,091,282	192,657,668.85	2.47
95	CEDEVIS	07-3U	mxAAA	282,845	49,379,389.82	0.63
95	CEDEVIS	0810U	mxAAA	629,497	238,974,515.26	3.06
95	CEDEVIS	08-2U	mxAAA	609,363	199,121,905.21	2.55
95	CEDEVIS	08-4U	mxAAA	6,190	2,939,295.61	0.04
95	CEDEVIS	08-6U	mxAAA	330,021	129,843,869.49	1.66
95	CEDEVIS	09U	mxAAA	479,334	72,960,262.66	0.94
95	CEDEVIS	09-2U	mxAAA	1,017,614	174,765,418.11	2.24
95	CEDEVIS	09-3U	mxAAA	903,969	150,378,349.19	1.93
95	CEDEVIS	09-4U	mxAAA	2,143,052	385,661,674.88	4.94
95	CEDEVIS	09-5U	mxAAA	796,541	129,860,789.74	1.66
95	CEDEVIS	10-2U	mxAAA	802,353	305,524,677.13	3.92
95	CEDEVIS	10-4U	mxAAA	1,065,017	479,530,527.59	6.15
95	CEDEVIS	10-5U	mxAAA	667,909	135,429,480.08	1.74
95	CEDEVIS	10-6U	mxAAA	1,953,937	374,515,083.01	4.80
95	CEDEVIS	11U	mxAAA	2,048,298	559,495,742.84	7.17
95	CEDEVIS	11-2U	mxAAA	3,014,351	857,674,703.76	11.00
95	CEDEVIS	12U	mxAAA	1,505,115	443,461,639.60	5.69
95	CEDEVIS	13U	mxAAA	695,316	192,568,860.63	2.47
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					6,666,854,576.22	85.48
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					6,666,854,576.22	85.48
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADO						
IS	BPA182	190704	mxAAA	486,074	50,009,316.24	0.64
IS	BPA182	210311	mxAAA	2,951,730	300,056,547.40	3.85
IS	BPA182	240307	mxAAA	325,874	32,818,854.82	0.42
LD	BONDES	191003	mxAAA	1,003,403	100,018,824.04	1.28
LD	BONDES	200130	mxAAA	500,085	50,009,367.07	0.64
LD	BONDES	210722	mxAAA	3,000,000	298,687,511.89	3.83
LD	BONDES	220512	mxAAA	1,008,540	100,018,943.80	1.28
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					931,619,365.26	11.94
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					7,799,700,138.83	100.00

CATEGORIZACIÓN
MEDIANO PLAZO

CALIFICACIÓN
AAA+/S4

VaR Promedio
0.265%

Límite de VaR
2.690%

ACTIVOS NETOS
7,834,731,600.82

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.