

NAFINTR Fondo Estratégico Nafinsa, S. A. de C. V., Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda.
CARTERA DE VALORES AL 10 agosto, 2017

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN						
CHM	BINTER	0194824		101,746,727	101,767,587.51	3.48
TOTAL DISPONIBILIDADES					101,767,587.51	3.48
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
S	UDIBONO	190613	mxAAA	85,922	50,633,909.18	1.73
PAPEL PRIVADO						
95	CDVITOT	11U	mxAAA	22,476	5,814,646.55	0.20
95	CDVITOT	11-3U	mxAAA	41,160	8,890,196.47	0.30
95	CDVITOT	12U	mxAAA	235,451	65,549,761.36	2.24
95	CDVITOT	13U	mxAAA	317,816	94,271,257.28	3.22
95	CDVITOT	14U	Aaa.mx	358,301	103,073,578.75	3.52
95	CDVITOT	15U	mxAAA	183,549	74,758,226.90	2.56
95	CEDEVIS	06U	mxAAA	129,899	12,218,500.76	0.42
95	CEDEVIS	06-2U	mxAAA	81,650	7,376,459.49	0.25
95	CEDEVIS	07U	mxAAA	287,621	37,726,744.96	1.29
95	CEDEVIS	07-3U	mxAAA	103,206	18,203,289.95	0.62
95	CEDEVIS	0810U	mxAAA	240,001	78,186,906.10	2.67
95	CEDEVIS	08-2U	mxAAA	218,000	71,980,554.32	2.46
95	CEDEVIS	08-6U	mxAAA	52,923	21,047,716.58	0.72
95	CEDEVIS	09U	mxAAA	222,705	34,755,909.53	1.19
95	CEDEVIS	09-2U	mxAAA	103,633	15,038,041.10	0.51
95	CEDEVIS	10-2U	mxAAA	103,340	39,751,696.73	1.36
95	CEDEVIS	10-4U	mxAAA	353,181	139,673,510.06	4.77
95	CEDEVIS	10-5U	mxAAA	35,810	7,354,719.97	0.25
95	CEDEVIS	10-6U	mxAAA	635,429	123,132,544.56	4.21
95	CEDEVIS	11U	mxAAA	58,100	16,049,340.82	0.55
95	CEDEVIS	11-2U	mxAAA	38,731	9,861,104.63	0.34
95	CEDEVIS	12U	mxAAA	540,073	161,331,250.33	5.51
95	TFOVICB	15U	mxAAA	1,029	486,210.31	0.02
95	TFOVIS	10-4U	mxAAA	549,033	104,224,367.37	3.56
95	TFOVIS	11U	mxAAA	143,969	24,111,498.37	0.82
95	TFOVIS	11-3U	mxAAA	1,798	340,219.86	0.01
95	TFOVIS	12U	mxAAA	423,400	104,057,399.77	3.56
95	TFOVIS	12-2U	mxAAA	100,162	24,293,970.48	0.83
95	TFOVIS	12-4U	mxAAA	186,740	55,687,644.27	1.90
95	TFOVIS	13U	mxAAA	155,110	52,996,383.60	1.81
95	TFOVIS	13-2U	mxAAA	156,413	44,938,941.14	1.54
95	TFOVIS	13-3U	mxAAA	272,764	92,570,884.72	3.16
95	TFOVIS	14U	Aaa.mx	612,722	245,788,725.82	8.40
95	TFOVIS	14-2U	mxAAA	153,397	64,478,259.92	2.20
95	TFOVIS	14-3U	mxAAA	296,042	122,513,949.64	4.19
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					2,133,168,321.65	72.91
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					2,133,168,321.65	72.91
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADO						
BI	CETES	180118	mxAAA	14,524,017	140,747,126.69	4.81
BI	CETES	180621	mxAAA	26,570,601	250,048,258.79	8.55
IQ	BPAG91	200820	mxAAA	991,780	100,019,304.82	3.42
LD	BONDESD	190411	mxAAA	1,000,791	100,019,356.33	3.42
LD	BONDESD	200130	mxAAA	1,001,375	100,019,416.90	3.42
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					690,853,463.53	23.61
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					2,925,789,372.69	100.00

CATEGORIZACIÓN

MEDIANO PLAZO

CALIFICACIÓN
AAAf/S4

VaR Promedio

0.217%

Límite de VaR

1.980%

ACTIVOS NETOS

2,923,927,798.03

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.