

NAFINTR Fondo Estratégico 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	0194824		100,593,016	100,613,098.66	3.32
TOTAL DISPONIBILIDADES					100,613,098.66	3.32
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
S	UDIBONO	190613	mxAAA	85,922	50,143,971.71	1.66
PAPEL PRIVADO						
95	CDVITOT	11U	mxAAA	22,476	6,282,254.02	0.21
95	CDVITOT	11-3U	mxAAA	41,160	9,696,799.90	0.32
95	CDVITOT	12U	mxAAA	235,451	64,661,970.05	2.14
95	CDVITOT	13U	mxAAA	317,816	93,020,193.35	3.07
95	CDVITOT	14U	Aaa.mx	358,301	110,257,362.96	3.64
95	CDVITOT	15U	mxAAA	183,549	73,687,916.88	2.44
95	CEDEVIS	06U	mxAAA	129,899	11,970,760.38	0.40
95	CEDEVIS	06-2U	mxAAA	81,650	8,905,640.54	0.29
95	CEDEVIS	07U	mxAAA	287,621	37,323,088.16	1.23
95	CEDEVIS	07-3U	mxAAA	103,206	18,017,816.49	0.60
95	CEDEVIS	0810U	mxAAA	240,001	91,111,034.11	3.01
95	CEDEVIS	08-2U	mxAAA	218,000	71,235,987.97	2.35
95	CEDEVIS	08-6U	mxAAA	52,923	20,822,090.43	0.69
95	CEDEVIS	09U	mxAAA	222,705	33,898,315.78	1.12
95	CEDEVIS	09-2U	mxAAA	103,633	17,797,971.11	0.59
95	CEDEVIS	10-2U	mxAAA	103,340	39,350,410.77	1.30
95	CEDEVIS	10-4U	mxAAA	353,181	159,021,941.68	5.26
95	CEDEVIS	10-5U	mxAAA	35,810	7,261,063.53	0.24
95	CEDEVIS	10-6U	mxAAA	635,429	121,793,970.16	4.02
95	CEDEVIS	11U	mxAAA	58,100	15,870,104.18	0.52
95	CEDEVIS	11-2U	mxAAA	38,731	11,020,149.59	0.36
95	CEDEVIS	12U	mxAAA	540,073	159,125,155.28	5.26
95	TFOVICB	15U	mxAAA	1,029	489,400.17	0.02
95	TFOVIS	10-4U	mxAAA	549,033	108,505,111.78	3.59
95	TFOVIS	11U	mxAAA	143,969	25,387,013.90	0.84
95	TFOVIS	11-3U	mxAAA	1,798	354,257.25	0.01
95	TFOVIS	12U	mxAAA	423,400	107,457,303.88	3.55
95	TFOVIS	12-2U	mxAAA	100,162	25,038,137.38	0.83
95	TFOVIS	12-4U	mxAAA	186,740	56,990,480.14	1.88
95	TFOVIS	13U	mxAAA	155,110	53,863,374.51	1.78
95	TFOVIS	13-2U	mxAAA	156,413	45,522,717.94	1.50
95	TFOVIS	13-3U	mxAAA	272,764	94,067,616.34	3.11
95	TFOVIS	14U	Aaa.mx	612,722	248,985,241.35	8.23
95	TFOVIS	14-2U	mxAAA	153,397	65,059,978.62	2.15
95	TFOVIS	14-3U	mxAAA	296,042	124,042,654.57	4.10
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					2,188,039,256.86	72.31
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					2,188,039,256.86	72.31
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADO						
IS	BPA182	190704	mxAAA	972,149	100,018,735.36	3.31
IS	BPA182	210311	mxAAA	2,951,730	300,056,547.40	9.92
IS	BPA182	220908	mxAAA	1,344,640	137,313,574.75	4.54
LD	BONDES	180419	mxAAA	21,865	2,183,426.45	0.07
LD	BONDES	200130	mxAAA	1,000,171	100,018,834.15	3.31
LD	BONDES	220317	mxAAA	986,179	97,835,427.19	3.23
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					737,426,545.30	24.37
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					3,026,078,900.82	100.00

CATEGORIZACIÓN
MEDIANO PLAZO

CALIFICACIÓN
AAA/S4

VaR Promedio

Límite de VaR

0.226%

1.980%

ACTIVOS NETOS
3,094,724,032.64

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.