

**NAFINTR Fondo Estratégico Nafinsa, S. A. de C. V., Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda.
CARTERA DE VALORES AL 31 MAYO, 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	78,497	56,417,143.66	3.15
2U	CBIC009	331124	mxAAA	41	32,204.74	0.00
TÍTULOS BANCARIOS						
95	TFOVIE	12U	Aaa.mx	9	16,553.68	0.00
PAPEL PRIVADO						
95	CDVITOT	11U	mxAAA	22,476	3,466,612.90	0.19
95	CDVITOT	12-2U	mxAAA	47,058	8,146,121.11	0.46
95	CDVITOT	13U	mxAAA	96,656	15,058,805.59	0.84
95	CDVITOT	14U	Aaa.mx	16,230	2,825,047.62	0.16
95	CDVITOT	14-2U	AA+(mex)	1,576	359,748.21	0.02
95	CDVITOT	15U	mxAAA	54,389	11,833,273.86	0.66
95	CEDEVIS	11U	mxAAA	113,701	10,934,773.55	0.61
95	CEDEVIS	12U	mxAAA	134,023	27,118,004.61	1.51
95	FOVISCB	17U	AAA(mex)	58,209	26,894,164.22	1.50
95	FOVISCB	18U	Aaa.mx	6,886	3,629,732.35	0.20
95	FOVISCB	19U	Aaa.mx	206,685	133,799,213.24	7.47
95	FOVISCB	19-2U	Aaa.mx	265,036	170,016,301.74	9.50
95	TFOVICB	12-3U	mxAAA	275,978	22,777,147.11	1.27
95	TFOVICB	13U	mxAAA	176,749	31,950,748.46	1.78
95	TFOVICB	13-3U	mxAAA	509,280	88,196,685.15	4.93
95	TFOVICB	15U	mxAAA	404,552	152,035,679.49	8.49
95	TFOVICB	15-2U	mxAAA	96,889	41,613,711.17	2.32
95	TFOVICB	16U	AAA(mex)	36,852	15,010,495.28	0.84
95	TFOVICB	20U	AAA(mex)	151,013	93,776,505.02	5.24
95	TFOVICB	20-2U	AAA(mex)	37,866	24,115,567.77	1.35
95	TFOVIS	12-4U	mxAAA	221,303	24,150,122.30	1.35
95	TFOVIS	13-2U	mxAAA	165,039	16,485,444.84	0.92
95	TFOVIS	14U	Aaa.mx	534,136	145,774,091.79	8.14
95	TFOVIS	14-2U	mxAAA	124,197	37,499,625.37	2.09
95	TFOVIS	14-3U	mxAAA	325,386	87,240,053.93	4.87
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					1,251,173,578.76	69.88
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					1,251,173,578.76	69.88
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADOR						
BI	CETES	220505	mxAAA	8,357,767	80,008,994.11	4.47
IQ	BPAG91	240502	mxAAA	1,202,943	120,013,229.70	6.70
IS	BPA182	240905	mxAAA	484,059	49,129,834.58	2.74
LD	BONDESD	220317	mxAAA	1,198,535	120,013,266.11	6.70
LD	BONDESD	240229	mxAAA	1,704,896	170,018,983.12	9.50
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					539,184,307.62	30.12
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					1,790,357,886.38	100.00

CATEGORÍA
MEDIANO PLAZO

CALIFICACIÓN
AAAf/S4

VaR Promedio
0.204%

Límite de VaR
1.200%

ACTIVOS NETOS
1,785,607,922.68

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.