

NAFINTR Fondo Estratégico Nafinsa, S. A. de C. V., Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda.  
CARTERA DE VALORES AL 17 JUNIO, 2021

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
<b>TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>						
<b>INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA</b>						
<b>VALORES GUBERNAMENTALES</b>						
S	UDIBONO	231116	mxAAA	78,497	56,834,843.85	3.17
2U	CBIC004	310116	mxAAA	2,987	2,709,105.84	0.15
2U	CBIC009	331124	mxAAA	41	32,323.05	0.00
<b>TÍTULOS BANCARIOS</b>						
95	TFOVIE	12U	Aaa.mx	9	16,588.13	0.00
<b>PAPEL PRIVADO</b>						
95	CDVITOT	11U	mxAAA	22,476	3,493,255.01	0.19
95	CDVITOT	12-2U	mxAAA	47,058	8,208,257.44	0.46
95	CDVITOT	13U	mxAAA	96,656	15,162,407.78	0.85
95	CDVITOT	14U	Aaa.mx	16,230	2,845,702.35	0.16
95	CDVITOT	14-2U	AA+(mex)	1,576	362,415.13	0.02
95	CDVITOT	15U	mxAAA	54,389	11,938,293.64	0.67
95	CEDEVIS	11U	mxAAA	113,701	10,984,990.73	0.61
95	CEDEVIS	12U	mxAAA	134,023	27,361,087.75	1.53
95	FOVISCB	17U	AAA(mex)	58,209	26,976,853.01	1.50
95	FOVISCB	18U	Aaa.mx	6,886	3,641,012.60	0.20
95	FOVISCB	19U	Aaa.mx	237,485	155,989,947.34	8.70
95	FOVISCB	19-2U	Aaa.mx	265,036	172,024,382.25	9.59
95	TFOVICB	12-3U	mxAAA	275,978	22,845,739.51	1.27
95	TFOVICB	13U	mxAAA	178,762	32,623,253.42	1.82
95	TFOVICB	13-3U	mxAAA	509,280	88,745,802.56	4.95
95	TFOVICB	15U	mxAAA	404,552	153,258,043.06	8.54
95	TFOVICB	15-2U	mxAAA	96,889	41,734,463.06	2.33
95	TFOVICB	16U	AAA(mex)	36,852	15,163,874.52	0.85
95	TFOVICB	20U	AAA(mex)	151,013	96,058,848.31	5.35
95	TFOVICB	20-2U	AAA(mex)	37,866	24,190,873.47	1.35
95	TFOVIS	12-4U	mxAAA	221,303	24,308,724.41	1.36
95	TFOVIS	13-2U	mxAAA	165,039	16,534,999.12	0.92
95	TFOVIS	14U	Aaa.mx	534,136	147,578,158.56	8.23
95	TFOVIS	14-2U	mxAAA	124,197	37,936,210.62	2.11
95	TFOVIS	14-3U	mxAAA	325,386	88,218,409.26	4.92
<b>TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA</b>					1,287,778,865.78	71.79
<b>TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>					1,287,778,865.78	71.79
<b>OPERACIONES DE REPORTO</b>						
<b>REPORTADOR</b>						
BI	CETES	220113	mxAAA	10,000,000	97,441,676.44	5.43
BI	CETES	220602	mxAAA	8,366,325	80,008,818.25	4.46
IQ	BPAG91	240502	mxAAA	500,143	50,005,351.55	2.79
IS	BPA182	251002	mxAAA	355,701	36,093,372.28	2.01
IS	BPA182	260219	mxAAA	1,198,597	120,013,094.82	6.69
LD	BONDESD	220519	mxAAA	1,000,963	100,010,830.93	5.58
LD	BONDESD	221013	mxAAA	225,528	22,571,483.07	1.26
<b>TOTAL OPERACIONES DE REPORTO</b>					506,144,627.34	28.21
<b>TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES</b>					1,793,923,493.12	100.00

**CATEGORÍA**  
MEDIANO PLAZO

**CALIFICACIÓN**  
AAA/S4

**VaR Promedio**

**Límite de VaR**

0.191%

1.200%

**ACTIVOS NETOS**  
1,806,353,765.54

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.