

**NAFM-EX Fondo de Conservación Patrimonial Nafinsa, S. A. de C. V., Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda.
CARTERA DE VALORES AL 26 FEBRERO, 2021**

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
BI	CETES	210527	mxAAA	2,500,000	24,758,277.50	1.58
BI	CETES	210715	mxAAA	2,500,000	24,621,322.50	1.57
BI	CETES	211216	mxAAA	2,531,200	24,495,027.36	1.57
BI	CETES	221006	mxAAA	5,000,000	46,787,960.00	2.99
IS	BPA182	240307	mxAAA	1,450,000	147,793,949.90	9.44
IS	BPA182	270401	mxAAA	1,000,000	101,197,627.00	6.47
LD	BONDESD	220714	mxAAA	1,000,000	99,880,682.00	6.38
LD	BONDESD	220908	mxAAA	1,000,000	99,853,895.00	6.38
LD	BONDESD	221110	mxAAA	2,000,000	200,144,046.00	12.79
LD	BONDESD	230309	mxAAA	1,150,000	114,900,843.55	7.34
LD	BONDESD	230706	mxAAA	2,000,000	199,534,476.00	12.75
LD	BONDESD	230831	mxAAA	500,000	49,867,779.50	3.19
M	BONOS	270603	mxAAA	200,000	22,464,794.80	1.44
S	UDIBONO	251204	mxAAA	26,802	20,824,110.46	1.33
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					1,177,124,791.57	75.22
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					1,177,124,791.57	75.22
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADOR						
BI	CETES	211216	mxAAA	7,749,660	75,024,867.78	4.79
IM	BPAG28	211111	mxAAA	748,458	75,024,807.57	4.79
IM	BPAG28	220811	mxAAA	751,356	75,024,616.81	4.79
LD	BONDESD	231221	mxAAA	804,781	80,026,713.58	5.11
LD	BONDESD	240425	mxAAA	826,859	82,615,911.16	5.28
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					387,716,916.90	24.78
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					1,564,841,708.47	100.00

CATEGORÍA
MEDIANO PLAZO GUBERNAMENTAL

CALIFICACIÓN
AAA+/S4

VaR Promedio

0.053%

Límite de VaR

0.300%

ACTIVOS NETOS

1,575,475,286.70

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.