

**NAFINTR Fondo Estratégico Nafinsa, S. A. de C. V., Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda.
CARTERA DE VALORES AL 15 SEPTIEMBRE, 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	217,578	157,677,656.51	8.21
S	UDIBONO	251204	mxAAA	25,909	19,983,875.43	1.04
2U	CBIC004	310116	mxAAA	2,987	2,673,512.42	0.14
2U	CBIC009	331124	mxAAA	41	31,934.92	0.00
TÍTULOS BANCARIOS						
95	TFOVIE	12U	Aaa.mx	9	9,135.89	0.00
PAPEL PRIVADO						
95	CDVITOT	11U	mxAAA	22,476	2,985,517.53	0.16
95	CDVITOT	12-2U	mxAAA	47,058	7,110,124.75	0.37
95	CDVITOT	13U	mxAAA	96,656	15,281,762.18	0.80
95	CDVITOT	14U	Aaa.mx	16,230	2,449,975.68	0.13
95	CDVITOT	14-2U	AA+(mex)	1,576	311,570.28	0.02
95	CDVITOT	15U	mxAAA	54,389	11,940,948.64	0.62
95	CEDEVIS	11U	mxAAA	113,701	11,077,436.35	0.58
95	CEDEVIS	12U	mxAAA	134,023	23,714,174.36	1.23
95	FOVISC	17U	AAA(mex)	58,209	26,347,144.73	1.37
95	FOVISC	18U	Aaa.mx	6,886	3,561,798.12	0.19
95	FOVISC	19U	Aaa.mx	237,894	151,877,079.19	7.91
95	FOVISC	19-2U	Aaa.mx	345,036	215,549,895.53	11.22
95	TFOVICB	12-3U	mxAAA	275,978	18,667,267.83	0.97
95	TFOVICB	13U	mxAAA	179,164	30,039,823.92	1.56
95	TFOVICB	13-3U	mxAAA	509,280	83,111,346.61	4.33
95	TFOVICB	15U	mxAAA	487,764	177,939,758.62	9.26
95	TFOVICB	15-2U	mxAAA	96,889	41,011,265.25	2.13
95	TFOVICB	16U	AAA(mex)	36,852	14,633,773.98	0.76
95	TFOVICB	20U	AAA(mex)	151,013	93,047,336.79	4.84
95	TFOVICB	20-2U	AAA(mex)	37,866	23,683,087.68	1.23
95	TFOVIS	12-4U	mxAAA	221,303	20,985,750.32	1.09
95	TFOVIS	13-2U	mxAAA	165,039	14,578,679.80	0.76
95	TFOVIS	14U	Aaa.mx	534,136	140,605,081.99	7.32
95	TFOVIS	14-2U	mxAAA	124,197	36,333,757.96	1.89
95	TFOVIS	14-3U	mxAAA	325,386	83,788,596.44	4.36
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					1,431,009,069.70	74.49
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					1,431,009,069.70	74.49
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADOR						
BI	CETES	220602	mxAAA	6,216,350	60,120,426.90	3.13
IQ	BPAG91	211223	mxAAA	792,741	80,020,082.00	4.17
IS	BPA182	260903	mxAAA	397,653	40,008,142.13	2.08
LD	BONDES	240229	mxAAA	600,717	59,909,900.84	3.12
LD	BONDES	241219	mxAAA	1,202,691	120,030,302.75	6.25
LD	BONDES	251211	mxAAA	804,041	80,020,664.51	4.17
M	BONOS	211209	mxAAA	487,789	50,012,436.33	2.60
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					490,121,955.46	25.51
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					1,921,131,025.16	100.00

**CATEGORÍA
MEDIANO PLAZO**

CALIFICACIÓN
AAA+/S4

VaR Promedio
0.220%

Límite de VaR
1.200%

ACTIVOS NETOS
1,887,845,507.49

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.