

**NAFCDVI Fondo en CEDEVIS Nafinsa, S. A. de C. V., Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda.**  
**CARTERA DE VALORES AL 31 agosto, 2016**

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>PAPEL PRIVADO</b>						
95	CDVITOT	11U	mxAAA	129,973	38,531,793.63	0.42
95	CDVITOT	11-3U	mxAAA	518,600	134,081,558.87	1.47
95	CDVITOT	12U	mxAAA	766,814	238,085,303.76	2.62
95	CDVITOT	13U	mxAAA	1,069,844	364,992,162.13	4.01
95	CDVITOT	14U	AAA(mex)	1,065,341	368,215,327.94	4.05
95	CDVITOT	15U	mxAAA	663,999	327,518,371.94	3.60
95	CEDEVIS	06U	mxAAA	286,719	35,206,507.85	0.39
95	CEDEVIS	06-2U	mxAAA	610,465	74,835,645.57	0.82
95	CEDEVIS	06-3U	mxAAA	885,123	88,880,651.02	0.98
95	CEDEVIS	06-4U	mxAAA	773,550	68,858,252.54	0.76
95	CEDEVIS	07U	mxAAA	479,349	78,254,947.07	0.86
95	CEDEVIS	07-2U	mxAAA	1,091,282	204,203,799.08	2.25
95	CEDEVIS	07-3U	mxAAA	282,845	59,314,458.19	0.65
95	CEDEVIS	0810U	mxAAA	629,497	259,963,295.51	2.86
95	CEDEVIS	08-2U	mxAAA	609,363	236,660,306.41	2.60
95	CEDEVIS	08-6U	mxAAA	330,021	135,098,549.65	1.49
95	CEDEVIS	09U	mxAAA	479,334	95,791,748.28	1.05
95	CEDEVIS	09-2U	mxAAA	1,012,264	192,963,441.47	2.12
95	CEDEVIS	09-3U	mxAAA	903,969	169,147,746.80	1.86
95	CEDEVIS	09-4U	mxAAA	2,143,052	486,082,948.55	5.35
95	CEDEVIS	09-5U	mxAAA	796,541	167,873,124.19	1.85
95	CEDEVIS	10-2U	mxAAA	802,353	382,748,832.97	4.21
95	CEDEVIS	10-4U	mxAAA	1,065,017	515,349,631.97	5.67
95	CEDEVIS	10-5U	mxAAA	667,909	164,262,537.21	1.81
95	CEDEVIS	10-6U	mxAAA	1,999,837	486,031,179.23	5.34
95	CEDEVIS	11U	mxAAA	2,048,298	646,668,356.17	7.11
95	CEDEVIS	11-2U	mxAAA	2,644,979	792,275,999.28	8.71
95	CEDEVIS	12U	mxAAA	1,376,474	416,706,029.13	4.58
95	CEDEVIS	13U	AAA(mex)	703,764	204,195,568.58	2.25
<b>TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA</b>					<b>7,432,798,074.99</b>	<b>81.73</b>
<b>TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>					<b>7,432,798,074.99</b>	<b>81.73</b>
<b>OPERACIONES DE REPORTE</b>						
<b>REPORTADO</b>						
IS	BPA182	190411	mxAAA	1,472,933	150,017,933.27	1.65
LD	BONDES	190207	HR AAA	4,513,214	450,053,583.01	4.95
LD	BONDES	191226	HR AAA	2,512,861	250,029,805.72	2.75
LD	BONDES	200528	HR AAA	4,137,454	411,219,736.24	4.52
LD	BONDES	200924	HR AAA	1,004,365	100,011,928.33	1.10
S	UDIBONO	171214	Aaa.mx	531,635	300,035,713.78	3.30
<b>TOTAL OPERACIONES DE REPORTE</b>					<b>1,661,368,700.35</b>	<b>18.27</b>
<b>TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES</b>					<b>9,094,166,775.34</b>	<b>100.00</b>

**CATEGORIZACIÓN**  
MEDIANO PLAZO

**CALIFICACIÓN**  
AAA/5-F

**VaR Promedio**

**Límite de VaR**

0.229%

2.690%

**ACTIVOS NETOS**

9,079,766,415.19

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.