

**NAFINTR Fondo Estratégico 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>VALORES GUBERNAMENTALES</b>						
S	UDIBONO	220609	Aaa.mx	116,162	61,646,758.93	1.43
S	UDIBONO	251204	Aaa.mx	113,497	71,290,484.38	1.65
<b>PAPEL PRIVADO</b>						
95	CDVITOT	11-3U	mxAAA	41,160	10,641,721.87	0.25
95	CDVITOT	12U	mxAAA	235,451	73,104,328.89	1.70
95	CDVITOT	13U	mxAAA	305,257	104,142,671.67	2.42
95	CDVITOT	14U	AAA(mex)	358,301	123,840,085.21	2.87
95	CDVITOT	15U	mxAAA	385,149	189,975,246.10	4.41
95	CEDEVIS	06U	mxAAA	129,899	15,950,425.90	0.37
95	CEDEVIS	06-2U	mxAAA	81,650	10,009,305.14	0.23
95	CEDEVIS	06-3U	mxAAA	218,342	21,925,064.77	0.51
95	CEDEVIS	06-4U	mxAAA	307,512	27,373,458.67	0.64
95	CEDEVIS	07-3U	mxAAA	103,206	21,642,977.50	0.50
95	CEDEVIS	0810U	mxAAA	240,001	99,113,182.25	2.30
95	CEDEVIS	08-2U	mxAAA	218,000	84,665,374.82	1.97
95	CEDEVIS	08-6U	mxAAA	52,923	21,664,744.19	0.50
95	CEDEVIS	09U	mxAAA	222,705	44,506,129.96	1.03
95	CEDEVIS	09-2U	mxAAA	94,327	17,981,141.82	0.42
95	CEDEVIS	10-2U	mxAAA	103,340	49,296,586.91	1.14
95	CEDEVIS	10-4U	mxAAA	353,181	170,900,275.18	3.97
95	CEDEVIS	10-5U	mxAAA	35,810	8,806,950.43	0.20
95	CEDEVIS	10-6U	mxAAA	623,009	151,413,239.65	3.51
95	CEDEVIS	11U	mxAAA	58,100	18,342,756.52	0.43
95	CEDEVIS	11-2U	mxAAA	62,686	18,776,940.49	0.44
95	CEDEVIS	12U	mxAAA	348,745	105,577,107.98	2.45
95	TFOVIS	10-2U	AAA(mex)	629,417	77,889,076.66	1.81
95	TFOVIS	10-3U	AAA(mex)	753,083	78,204,211.39	1.82
95	TFOVIS	10-4U	AAA(mex)	549,033	129,027,661.71	3.00
95	TFOVIS	11U	AAA(mex)	143,969	31,453,526.21	0.73
95	TFOVIS	11-2U	AAA(mex)	842,297	147,410,334.80	3.42
95	TFOVIS	12U	AAA(mex)	423,400	124,109,819.80	2.88
95	TFOVIS	12-2U	AAA(mex)	464,162	135,224,318.24	3.14
95	TFOVIS	12-3U	AAA(mex)	188,239	60,053,715.18	1.39
95	TFOVIS	12-4U	AAA(mex)	80,388	26,892,969.04	0.62
95	TFOVIS	13-2U	AAA(mex)	479,059	158,566,840.32	3.68
95	TFOVIS	13-3U	AAA(mex)	484,375	182,595,039.92	4.24
95	TFOVIS	14U	AAA(mex)	318,419	139,123,835.50	3.23
95	TFOVIS	14-3U	AAA(mex)	296,042	131,398,493.93	3.05
<b>TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA</b>					<b>2,944,536,801.93</b>	<b>68.35</b>
<b>TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>					<b>2,944,536,801.93</b>	<b>68.35</b>
<b>OPERACIONES DE REPORTE</b>						
<b>REPORTADO</b>						
IS	BPA182	171005	mxAAA	2,088,475	212,446,918.68	4.93
IS	BPA182	190411	mxAAA	490,977	50,005,909.85	1.16
IS	BPA182	200130	mxAAA	521,407	52,060,902.68	1.21
IS	BPA182	201022	mxAAA	1,974,464	200,876,319.81	4.66
LD	BONDESD	190606	HR AAA	480,213	47,951,138.62	1.11
LD	BONDESD	191226	HR AAA	1,504,570	150,017,942.18	3.48
LD	BONDESD	200130	mxAAA	2,515,466	250,029,798.66	5.80
LD	BONDESD	200924	HR AAA	1,004,365	100,011,928.33	2.32
S	UDIBONO	171214	Aaa.mx	531,635	300,035,713.78	6.96
<b>TOTAL OPERACIONES DE REPORTE</b>					<b>1,363,436,572.59</b>	<b>31.65</b>
<b>TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES</b>					<b>4,307,973,374.52</b>	<b>100.00</b>

**CATEGORIZACIÓN**  
MEDIANO PLAZO

**CALIFICACIÓN**  
AAA/5-F

**VaR Promedio**

**Límite de VaR**

0.175%

1.980%

**ACTIVOS NETOS**

4,263,266,421.70

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.