

**NAFCDVI Fondo en CEDEVIS Nafinsa, S. A. de C. V., Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda.
CARTERA DE VALORES AL 30 JUNIO, 2022**

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
PAPEL PRIVADO						
93	FHIPO	00322	HR+1	200,000	20,026,015.60	0.61
95	CDVITOT	11U	mxAAA	456,572	54,014,824.42	1.63
95	CDVITOT	11-3U	mxAAA	665,339	60,969,773.07	1.84
95	CDVITOT	13U	mxAAA	2,139,128	256,054,656.94	7.74
95	CDVITOT	13-2U	mxAA+	250,960	38,320,616.27	1.16
95	CDVITOT	14U	AAA.mx	1,998,662	265,293,825.62	8.01
95	CDVITOT	14-2U	AA+(mex)	193,727	33,674,502.01	1.02
95	CDVITOT	15U	mxAAA	1,601,282	271,212,078.70	8.19
95	CDVITOT	15-2U	mxAA+	74,280	16,211,978.13	0.49
95	CEDEVIS	08-4U	AAA.mx	495,699	68,264,223.65	2.06
95	CEDEVIS	08-6U	mxAAA	1,082,640	135,380,619.92	4.09
95	CEDEVIS	12U	mxAAA	1,344,287	229,735,071.15	6.94
95	CEDEVIS	13U	AAA.mx	574,615	85,635,381.98	2.59
95	FHIPOCB	17U	AAA(mex)	266,113	102,516,609.97	3.10
95	FHIPOCB	20	mxAAA	2,000,000	143,165,964.00	4.32
95	FHIPOCB	21-3	HR AAA	7,500,000	690,142,425.00	20.85
95	FOVISCB	18U	AAA.mx	240,494	112,141,337.07	3.39
95	FOVISCB	19-2U	AAA.mx	61,000	34,184,832.31	1.03
95	HITOTAL	10U	AAA.mx	1,828,640	137,886,763.25	4.17
95	TFOVIS	14-3U	mxAAA	73,063	16,525,517.78	0.50
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					2,771,357,016.84	83.72
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					2,771,357,016.84	83.72
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADOR						
BI	CETES	230309	mxAAA	5,287,079	50,010,755.33	1.51
IM	BPAG28	231109	mxAAA	1,000,481	100,021,483.38	3.02
IQ	BPAG91	260903	mxAAA	220,489	22,055,548.96	0.67
IQ	BPAG91	260903	mxAAA	1,199,896	120,025,783.47	3.63
IS	BPA182	260903	mxAAA	652,410	66,805,188.84	2.02
LD	BONDESD	231101	mxAAA	500,587	50,010,677.93	1.51
LF	BONDESF	240425	mxAAA	800,883	80,017,097.16	2.42
M	BONOS	241205	mxAAA	490,523	50,010,713.60	1.51
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					538,957,248.67	16.28
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					3,310,314,265.51	100.00

**CATEGORÍA
MEDIANO PLAZO**

CALIFICACIÓN
AAA+/S4

VaR Promedio
0.185%

Límite de VaR
2.690%

ACTIVOS NETOS
3,306,364,209.97

En el cálculo del VAR se utiliza el método paramétrico con un nivel de confianza del 95% a dos colas sin tomar en cuenta algún factor de decaimiento exponencial una muestra de 252 observaciones y un horizonte de tiempo a un día