

NAFCDVI Fondo en CEDEVIS Nafinsa, S. A. de C. V., Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda.
CARTERA DE VALORES AL 30 DICIEMBRE, 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	00122	HR+1	40,000	4,022,170.48	0.12
93	FHIPO	00222	HR+1	37,835	3,797,294.15	0.11
93	FHIPO	00422	1/M	400,000	40,208,634.00	1.18
95	CDVITOT	11U	mxAAA	456,572	48,092,890.17	1.42
95	CDVITOT	11-3U	mxAAA	665,339	53,220,488.57	1.57
95	CDVITOT	13U	mxAAA	2,139,128	210,557,254.72	6.20
95	CDVITOT	13-2U	mxAAA+	250,960	31,579,945.36	0.93
95	CDVITOT	14U	AAA.mx	2,020,108	232,981,322.20	6.86
95	CDVITOT	14-2U	AA+(mex)	193,727	29,241,723.32	0.86
95	CDVITOT	15U	mxAAA	1,601,282	224,197,199.79	6.60
95	CDVITOT	15-2U	mxAAA+	74,280	13,348,075.00	0.39
95	CEDEVIS	12U	mxAAA	1,354,828	204,091,795.27	6.01
95	CEDEVIS	13U	AAA.mx	574,615	75,109,328.71	2.21
95	FHIPOCB	17U	AAA(mex)	271,034	95,547,012.16	2.81
95	FHIPOCB	20	mxAAA	2,000,000	143,057,070.00	4.21
95	FHIPOCB	21-3	HR AAA	7,500,000	694,820,797.50	20.45
95	FOVISC	18U	AAA.mx	348,494	156,372,742.74	4.60
95	FOVISC	19U	AAA.mx	105,500	59,627,915.09	1.76
95	FOVISC	19-2U	AAA.mx	239,113	130,287,220.49	3.83
95	HITOTAL	10U	AAA.mx	1,412,957	107,934,208.37	3.18
95	TFOVICB	15U	mxAAA	487,764	152,090,933.22	4.48
95	TFOVICB	20U	AAA(mex)	152,498	82,366,427.53	2.42
95	TFOVIS	14-3U	mxAAA	73,063	14,655,015.48	0.43
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					2,807,207,464.32	82.63
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					2,807,207,464.32	82.63
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADOR						
BI	CETES	230615	mxAAA	9,670,244	92,211,254.67	2.71
IM	BPAG28	230810	mxAAA	500,280	50,043,572.86	1.47
IQ	BPAG91	250430	mxAAA	1,180,531	120,105,002.50	3.54
IQ	BPAG91	251231	mxAAA	491,252	50,043,870.40	1.47
IS	BPA182	260903	mxAAA	676,857	69,812,186.90	2.05
LD	BONDES	231221	mxAAA	500,185	50,043,777.94	1.47
LD	BONDES	240229	mxAAA	78,307	7,876,411.46	0.23
LF	BONDES	240725	mxAAA	499,099	50,043,938.70	1.47
M	BONOS	330526	mxAAA	555,617	50,043,332.72	1.47
M	BONOS	330526	mxAAA	555,231	50,043,548.47	1.47
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					590,266,896.62	17.37
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					3,397,474,360.94	100.00

CATEGORÍA
MEDIANO PLAZO

CALIFICACIÓN
AAA+/S4

VaR Promedio

0.229%

Límite de VaR

2.690%

ACTIVOS NETOS
3,393,090,149.12

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