

## Composición de la Cartera de Inversión al 30 de junio de 2022.

<b>APIBONO</b>					
Fondo Banorte 33, S.A. de C.V. Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda					
Categoría: Largo Plazo Gubernamental					
Calificación: AAAf/S6(mex)					
T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
<b>INVERSIONES EN VALORES</b>					
<b>TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>					
<b>Deuda Gubernamental</b>					
<b>Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LD</b>				<b>\$21,988,372</b>	<b>2.72 %</b>
LD	BONDESD	240801	AAA(mex)	\$5,005,620	0.62 %
LD	BONDESD	230629	AAA(mex)	\$4,997,722	0.62 %
LD	BONDESD	260409	AAA(mex)	\$4,990,823	0.62 %
LD	BONDESD	240404	AAA(mex)	\$4,988,297	0.62 %
LD	BONDESD	220908	AAA(mex)	\$2,005,910	0.25 %
<b>Bonos de Protección al Ahorro (Pago Mensual)</b>				<b>\$11,529,886</b>	<b>1.43 %</b>
IM	BPAG28	230511	AAA(mex)	\$6,522,720	0.81 %
IM	BPAG28	240509	AAA(mex)	\$5,007,166	0.62 %
<b>Bonos del Gobierno Federal (Tasa Fija)</b>				<b>\$642,785,504</b>	<b>79.62 %</b>
M	BONOS	260305	AAA(mex)	\$77,864,138	9.65 %
M	BONOS	241205	AAA(mex)	\$75,003,061	9.29 %
M	BONOS	240905	AAA(mex)	\$63,688,943	7.89 %
M	BONOS	270603	AAA(mex)	\$62,008,506	7.68 %
M	BONOS	310529	AAA(mex)	\$59,531,606	7.37 %
M	BONOS	290531	AAA(mex)	\$55,785,696	6.91 %
M	BONOS	231207	AAA(mex)	\$48,340,907	5.99 %
M	BONOS	471107	AAA(mex)	\$44,692,970	5.54 %
M	BONOS	381118	AAA(mex)	\$43,585,372	5.40 %
M	BONOS	421113	AAA(mex)	\$36,725,919	4.55 %
M	BONOS	270304	AAA(mex)	\$17,077,764	2.12 %
M	BONOS	230309	AAA(mex)	\$16,267,518	2.02 %
M	BONOS	361120	AAA(mex)	\$14,328,787	1.77 %
M	BONOS	341123	AAA(mex)	\$14,189,453	1.76 %
M	BONOS	250306	AAA(mex)	\$13,694,864	1.70 %
<b>Certificados de la Tesorería de la Federación</b>				<b>\$68,544,336</b>	<b>8.49 %</b>
BI	CETES	221006	AAA(mex)	\$16,628,222	2.06 %
BI	CETES	221020	AAA(mex)	\$9,744,817	1.21 %
BI	CETES	220714	AAA(mex)	\$4,985,992	0.62 %
BI	CETES	220728	AAA(mex)	\$4,971,345	0.62 %
BI	CETES	220825	AAA(mex)	\$4,939,900	0.61 %
BI	CETES	220922	AAA(mex)	\$4,906,917	0.61 %
BI	CETES	230209	AAA(mex)	\$4,727,505	0.59 %
BI	CETES	230309	AAA(mex)	\$4,692,547	0.58 %
BI	CETES	230504	AAA(mex)	\$4,623,919	0.57 %
BI	CETES	230601	AAA(mex)	\$4,589,722	0.57 %
BI	CETES	220908	AAA(mex)	\$3,733,450	0.46 %
<b>Udibonos</b>				<b>\$10,734,567</b>	<b>1.33 %</b>
S	UDIBONO	231116	AAA(mex)	\$10,031,783	1.24 %
S	UDIBONO	351122	AAA(mex)	\$450,033	0.06 %
S	UDIBONO	461108	AAA(mex)	\$252,751	0.03 %
<b>Total Deuda Gubernamental</b>				<b>\$755,582,665</b>	<b>93.60 %</b>
<b>TOTAL DE TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>				<b>\$755,582,665</b>	<b>93.60 %</b>



T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
<b>TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES</b>				<b>\$755,582,665</b>	<b>93.60 %</b>
<b>OPERACIONES DE REPORTE</b>					
<b>REPORTADOR</b>					
<b>Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)</b>				<b>\$51,683,696</b>	<b>6.40 %</b>
IQ	BPAG91	260903	AAA(mex)	\$51,683,696	6.40 %
<b>TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE</b>				<b>\$51,683,696</b>	<b>6.40 %</b>
<b>TOTAL DE CARTERA:</b>				<b>\$807,266,361</b>	<b>100.00 %</b>
Límite Máximo de VaR: 2.500%				VaR Promedio: 0.3917%	
Valor en Riesgo (VaR) Supuestos y Metodología: Horizonte de tiempo de un día y con nivel de confianza al 95% a dos colas basada en una simulación histórica no paramétrica de 500 observaciones.					
Actualmente el Fondo no se encuentra en estrategia temporal de inversión.					

