

Composición de la Cartera de Inversión al 31 de mayo de 2024.

APIBONO					
Fondo Banorte 33, S.A. de C.V. Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda					
Categoría: Largo Plazo Gubernamental					
Calificación: AAAf/S5(mex)					
T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS					
INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES					
Deuda Gubernamental					
Bonos del Gobierno Federal (Tasa Fija)				\$655,254,778	84.23 %
M	BONOS	330526	AAA(mex)	\$64,522,282	8.29 %
M	BONOS	260305	AAA(mex)	\$62,158,846	7.99 %
M	BONOS	270603	AAA(mex)	\$61,072,285	7.85 %
M	BONOS	310529	AAA(mex)	\$58,570,653	7.53 %
M	BONOS	270304	AAA(mex)	\$49,266,512	6.33 %
M	BONOS	421113	AAA(mex)	\$44,062,807	5.66 %
M	BONOS	290531	AAA(mex)	\$41,144,412	5.29 %
M	BONOS	240905	AAA(mex)	\$40,739,865	5.24 %
M	BONOS	471107	AAA(mex)	\$34,724,398	4.46 %
M	BONOS	260903	AAA(mex)	\$33,173,727	4.26 %
M	BONOS	530731	AAA(mex)	\$32,558,183	4.19 %
M	BONOS	381118	AAA(mex)	\$30,715,836	3.95 %
M	BONOS	241205	AAA(mex)	\$27,137,998	3.49 %
M	BONOS	290301	AAA(mex)	\$22,712,699	2.92 %
M	BONOS	341123	AAA(mex)	\$21,883,089	2.81 %
M	BONOS	250306	AAA(mex)	\$19,928,580	2.56 %
M	BONOS	361120	AAA(mex)	\$10,882,606	1.40 %
Certificados de la Tesorería de la Federación				\$110,892,710	14.25 %
BI	CETES	240627	AAA(mex)	\$9,926,987	1.28 %
BI	CETES	240822	AAA(mex)	\$9,758,862	1.25 %
BI	CETES	241211	AAA(mex)	\$9,439,358	1.21 %
BI	CETES	250306	AAA(mex)	\$9,204,063	1.18 %
BI	CETES	250430	AAA(mex)	\$9,059,569	1.16 %
BI	CETES	241003	AAA(mex)	\$4,817,275	0.62 %
BI	CETES	241017	AAA(mex)	\$4,796,740	0.62 %
BI	CETES	241114	AAA(mex)	\$4,756,655	0.61 %
BI	CETES	250109	AAA(mex)	\$4,678,738	0.60 %
BI	CETES	250123	AAA(mex)	\$4,659,345	0.60 %
BI	CETES	250206	AAA(mex)	\$4,640,138	0.60 %
BI	CETES	250320	AAA(mex)	\$4,591,885	0.59 %
BI	CETES	250403	AAA(mex)	\$4,566,008	0.59 %
BI	CETES	250515	AAA(mex)	\$4,530,624	0.58 %
BI	CETES	250529	AAA(mex)	\$4,494,416	0.58 %
BI	CETES	250710	AAA(mex)	\$4,439,761	0.57 %
BI	CETES	251224	AAA(mex)	\$4,240,037	0.55 %
BI	CETES	260219	AAA(mex)	\$4,176,447	0.54 %
BI	CETES	260416	AAA(mex)	\$4,115,802	0.53 %
Total Deuda Gubernamental				\$766,147,488	98.49 %
TOTAL DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES				\$766,147,488	98.49 %
TOTAL DE INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS				\$766,147,488	98.49 %
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADOR					


Swiss Certified
ISO 9001:2015

Signatory of:



T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
	Bonos de Protección al Ahorro (Pago Semestral)			\$11,782,611	1.51 %
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	\$11,782,611	1.51 %
TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE				\$11,782,611	1.51 %
TOTAL DE CARTERA:				\$777,930,099	100.00%
Límite Máximo de VaR: 2.500%				VaR Promedio: 0.2602%	
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 501 observaciones.					
Actualmente el Fondo no se encuentra en estrategia temporal de inversión.					

