

Composición de la Cartera de Inversión al 27 de marzo de 2024.

| APICP | | | | | |
|---|--|--------|------------|-------------------------|-----------------|
| Fondo Banorte 7, S.A. de C.V. Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda | | | | | |
| Categoría: Corto Plazo Gubernamental | | | | | |
| Calificación: AAAf/S2(mex) | | | | | |
| T. VALOR | EMISORA | SERIE | CALIF/BURS | VALOR RAZONABLE TOTAL | % PARTICIPACIÓN |
| INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS | | | | | |
| INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES | | | | | |
| Deuda Gubernamental | | | | | |
| | Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LD | | | \$11,146,757 | 0.08 % |
| LD | BONDESD | 240801 | AAA(mex) | \$5,026,264 | 0.04 % |
| LD | BONDESD | 260409 | AAA(mex) | \$5,012,353 | 0.04 % |
| LD | BONDESD | 240822 | AAA(mex) | \$1,108,140 | 0.01 % |
| | Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LF | | | \$30,084,170 | 0.21 % |
| LF | BONDESF | 241128 | AAA(mex) | \$30,084,170 | 0.21 % |
| | Bonos de Protección al Ahorro (Pago Mensual) | | | \$807,638,048 | 5.68 % |
| IM | BPAG28 | 240509 | AAA(mex) | \$286,579,866 | 2.01 % |
| IM | BPAG28 | 240808 | AAA(mex) | \$280,866,211 | 1.97 % |
| IM | BPAG28 | 241107 | AAA(mex) | \$240,191,971 | 1.69 % |
| | Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral) | | | \$203,824,095 | 1.43 % |
| IQ | BPAG91 | 250102 | AAA(mex) | \$123,267,390 | 0.87 % |
| IQ | BPAG91 | 260903 | AAA(mex) | \$50,261,620 | 0.35 % |
| IQ | BPAG91 | 240829 | AAA(mex) | \$30,295,085 | 0.21 % |
| | Bonos del Gobierno Federal (Tasa Fija) | | | \$20,514,012 | 0.14 % |
| M | BONOS | 241205 | AAA(mex) | \$20,514,012 | 0.14 % |
| | Certificados de la Tesorería de la Federación | | | \$12,795,230,154 | 89.94 % |
| BI | CETES | 250123 | AAA(mex) | \$891,265,519 | 6.27 % |
| BI | CETES | 241003 | AAA(mex) | \$884,200,235 | 6.22 % |
| BI | CETES | 240502 | AAA(mex) | \$881,638,361 | 6.20 % |
| BI | CETES | 240919 | AAA(mex) | \$770,123,897 | 5.41 % |
| BI | CETES | 241128 | AAA(mex) | \$763,272,482 | 5.37 % |
| BI | CETES | 240530 | AAA(mex) | \$746,547,646 | 5.25 % |
| BI | CETES | 250109 | AAA(mex) | \$742,682,217 | 5.22 % |
| BI | CETES | 250206 | AAA(mex) | \$671,098,292 | 4.72 % |
| BI | CETES | 250710 | AAA(mex) | \$613,868,290 | 4.32 % |
| BI | CETES | 240627 | AAA(mex) | \$591,935,538 | 4.16 % |
| BI | CETES | 241211 | AAA(mex) | \$566,599,058 | 3.98 % |
| BI | CETES | 240822 | AAA(mex) | \$560,809,672 | 3.94 % |
| BI | CETES | 250320 | AAA(mex) | \$433,649,136 | 3.05 % |
| BI | CETES | 250515 | AAA(mex) | \$421,730,728 | 2.96 % |
| BI | CETES | 250306 | AAA(mex) | \$380,504,250 | 2.67 % |
| BI | CETES | 251030 | AAA(mex) | \$366,361,333 | 2.58 % |
| BI | CETES | 240418 | AAA(mex) | \$318,337,152 | 2.24 % |
| BI | CETES | 260219 | AAA(mex) | \$310,617,113 | 2.18 % |
| BI | CETES | 240404 | AAA(mex) | \$309,712,971 | 2.18 % |
| BI | CETES | 241017 | AAA(mex) | \$301,413,920 | 2.12 % |
| BI | CETES | 240808 | AAA(mex) | \$288,467,310 | 2.03 % |
| BI | CETES | 240725 | AAA(mex) | \$243,263,139 | 1.71 % |
| BI | CETES | 250904 | AAA(mex) | \$172,727,680 | 1.21 % |
| BI | CETES | 251224 | AAA(mex) | \$165,528,600 | 1.16 % |
| BI | CETES | 241114 | AAA(mex) | \$158,866,530 | 1.12 % |
| BI | CETES | 240905 | AAA(mex) | \$143,036,595 | 1.01 % |
| BI | CETES | 240711 | AAA(mex) | \$96,972,490 | 0.68 % |



Swiss Certified

ISO 9001:2015

Signatory of:



| T. VALOR | EMISORA | SERIE | CALIF/BURS | VALOR RAZONABLE TOTAL | % PARTICIPACIÓN |
|--|---|--------|------------|------------------------------|--------------------|
| Total Deuda Gubernamental | | | | \$13,868,437,236 | 97.49 % |
| TOTAL DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES | | | | \$13,868,437,236 | 97.49 % |
| TOTAL DE INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS | | | | \$13,868,437,236 | 97.49 % |
| OPERACIONES DE REPORTE REPORTADOR | | | | | |
| | Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LF | | | \$304,669,764 | 2.14 % |
| LF | BONDESF | 271014 | AAA(mex) | \$304,669,764 | 2.14 % |
| | Bonos de Protección al Ahorro (Pago Semestral) | | | \$52,556,819 | 0.37 % |
| IS | BPA182 | 260219 | AAA(mex) | \$52,556,819 | 0.37 % |
| TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE | | | | \$357,226,583 | 2.51 % |
| TOTAL DE CARTERA: | | | | \$14,225,663,819 | 100.00% |
| Límite Máximo de VaR: 0.120% | | | | VaR Promedio: 0.0412% | |
| 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. | | | | | |
| El Fondo no realizará estrategias temporales de Inversión. | | | | | |

