

Composición de la Cartera de Inversión al 31 de diciembre de 2021.

<b>APICP</b>					
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
<b>INVERSIONES EN VALORES</b>					
<b>TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>					
<b>Deuda Gubernamental</b>					
<b>Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LD</b>				<b>\$1,847,019,905</b>	<b>19.57 %</b>
LD	BONDESD	230629	AAA(mex)	\$305,442,271	3.24 %
LD	BONDESD	230105	AAA(mex)	\$150,424,110	1.59 %
LD	BONDESD	241219	AAA(mex)	\$149,556,912	1.58 %
LD	BONDESD	240229	AAA(mex)	\$145,076,351	1.54 %
LD	BONDESD	240404	AAA(mex)	\$114,947,097	1.22 %
LD	BONDESD	260212	AAA(mex)	\$109,407,120	1.16 %
LD	BONDESD	240201	AAA(mex)	\$105,071,684	1.11 %
LD	BONDESD	231221	AAA(mex)	\$99,897,363	1.06 %
LD	BONDESD	231005	AAA(mex)	\$99,828,245	1.06 %
LD	BONDESD	250619	AAA(mex)	\$89,802,055	0.95 %
LD	BONDESD	240822	AAA(mex)	\$80,994,535	0.86 %
LD	BONDESD	260409	AAA(mex)	\$74,569,667	0.79 %
LD	BONDESD	240801	AAA(mex)	\$69,839,903	0.74 %
LD	BONDESD	220317	AAA(mex)	\$68,807,063	0.73 %
LD	BONDESD	220908	AAA(mex)	\$52,006,131	0.55 %
LD	BONDESD	230330	AAA(mex)	\$50,124,439	0.53 %
LD	BONDESD	240425	AAA(mex)	\$50,017,403	0.53 %
LD	BONDESD	220714	AAA(mex)	\$31,207,556	0.33 %
<b>Bonos de Protección al Ahorro (Pago Mensual)</b>				<b>\$509,406,809</b>	<b>5.40 %</b>
IM	BPAG28	240808	AAA(mex)	\$129,546,916	1.37 %
IM	BPAG28	240509	AAA(mex)	\$104,783,714	1.11 %
IM	BPAG28	230810	AAA(mex)	\$74,883,799	0.79 %
IM	BPAG28	221110	AAA(mex)	\$50,137,230	0.53 %
IM	BPAG28	230209	AAA(mex)	\$50,059,726	0.53 %
IM	BPAG28	220811	AAA(mex)	\$50,001,605	0.53 %
IM	BPAG28	230511	AAA(mex)	\$49,993,819	0.53 %
<b>Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)</b>				<b>\$110,577,390</b>	<b>1.17 %</b>
IQ	BPAG91	230427	AAA(mex)	\$40,327,316	0.43 %
IQ	BPAG91	240829	AAA(mex)	\$29,986,490	0.32 %
IQ	BPAG91	220428	AAA(mex)	\$25,238,384	0.27 %
IQ	BPAG91	230831	AAA(mex)	\$15,025,200	0.16 %
<b>Bonos del Gobierno Federal (Tasa Fija)</b>				<b>\$118,630,039</b>	<b>1.26 %</b>
M	BONOS	241205	AAA(mex)	\$118,630,039	1.26 %
<b>Certificados de la Tesorería de la Federación</b>				<b>\$4,805,283,983</b>	<b>50.92 %</b>
BI	CETES	220113	AAA(mex)	\$698,937,117	7.41 %
BI	CETES	220602	AAA(mex)	\$555,935,706	5.89 %
BI	CETES	220407	AAA(mex)	\$526,910,158	5.58 %
BI	CETES	220331	AAA(mex)	\$424,058,733	4.49 %
BI	CETES	220210	AAA(mex)	\$387,750,207	4.11 %
BI	CETES	220825	AAA(mex)	\$311,659,855	3.30 %
BI	CETES	220310	AAA(mex)	\$306,794,011	3.25 %
BI	CETES	221006	AAA(mex)	\$294,721,650	3.12 %
BI	CETES	220630	AAA(mex)	\$290,975,340	3.08 %



T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
BI	CETES	220505	AAA(mex)	\$264,617,928	2.80 %
BI	CETES	220728	AAA(mex)	\$221,836,840	2.35 %
BI	CETES	221117	AAA(mex)	\$197,948,016	2.10 %
BI	CETES	221020	AAA(mex)	\$180,131,362	1.91 %
BI	CETES	220922	AAA(mex)	\$143,007,060	1.52 %
<b>Udibonos</b>				<b>\$441,012,057</b>	<b>4.67 %</b>
S	UDIBONO	220609	AAA(mex)	\$441,012,057	4.67 %
<b>Total Deuda Gubernamental</b>				<b>\$7,831,930,183</b>	<b>83.00 %</b>
<b>TOTAL DE TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>				<b>\$7,831,930,183</b>	<b>83.00 %</b>
<b>TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES</b>				<b>\$7,831,930,183</b>	<b>83.00 %</b>
<b>OPERACIONES DE REPORTE</b>					
<b>REPORTADOR</b>					
<b>Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LD</b>				<b>\$603,756,512</b>	<b>6.40 %</b>
LD	BONDESD	241219	AAA(mex)	\$603,756,512	6.40 %
<b>Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)</b>				<b>\$1,000,452,448</b>	<b>10.60 %</b>
IQ	BPAG91	260507	AAA(mex)	\$1,000,452,448	10.60 %
<b>TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE</b>				<b>\$1,604,208,960</b>	<b>17.00 %</b>
<b>TOTAL DE CARTERA:</b>				<b>\$9,436,139,143</b>	<b>100.00%</b>
<b>Límite Máximo de VaR: 0.120%</b>				<b>VaR Promedio: 0.0237%</b>	
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.					
<b>El Fondo no realizará estrategias temporales de Inversión.</b>					

