

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

NTEDP					
Fondo Banorte 10, S.A. de C.V. Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda					
Categoría: Mediano Plazo					
Calificación: AAAf/S4(mex)					
T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
EFFECTIVO Y EQUIVALENTES DE EFFECTIVO					
Chequera en Pesos				\$1	0.00 %
CHM	040072	7275285	N/A	\$1	0.00 %
TOTAL DE EFFECTIVO Y EQUIVALENTES DE EFFECTIVO				\$1	0.00 %
INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS					
INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES					
Deuda Bancaria					
Certificados Bursátiles Bancarios				\$1,919,456,677	20.03 %
94	BACOMER	20-2	AAA (mex)	\$105,967,332	1.11 %
94	BACTIN	22-2	AA (mex)	\$102,049,508	1.06 %
94	BACTIN	23	AA (mex)	\$101,428,927	1.06 %
94	BLADEX	21	AAA (mex)	\$100,774,671	1.05 %
94	BANORTE	24X	AAA (mex)	\$100,414,556	1.05 %
94	BSMX	23	AAA (mex)	\$100,224,132	1.05 %
94	BBVAMX	22X	AAA (mex)	\$86,008,083	0.90 %
94	BSMX	23-3	AAA (mex)	\$85,960,564	0.90 %
94	BSMX	22-3	AAA (mex)	\$85,313,381	0.89 %
94	BBVAMX	23-2	AAA (mex)	\$80,823,466	0.84 %
94	SCOTIAB	23	AAA (mex)	\$80,800,906	0.84 %
94	BSMX	22	AAA (mex)	\$80,739,756	0.84 %
94	BACTIN	23-3	AA (mex)	\$80,355,783	0.84 %
94	BLADEX	23	AAA (mex)	\$80,236,418	0.84 %
94	SCOTIAB	24	AAA (mex)	\$80,176,866	0.84 %
94	COMPART	21S	AA (mex)	\$75,479,456	0.79 %
94	COMPART	23S	AA (mex)	\$60,361,277	0.63 %
94	BSMX	21	AAA (mex)	\$60,254,898	0.63 %
94	BANORTE	23-4	mxAAA	\$50,513,778	0.53 %
94	BANORTE	19-2	mxAAA	\$50,292,742	0.52 %
94	BLADEX	24	AAA (mex)	\$50,218,772	0.52 %
94	BBVAMX	23V	AAA (mex)	\$50,207,097	0.52 %
94	BANORTE	23-2	AAA (mex)	\$50,172,413	0.52 %
94	BANORTE	23-3	Aaa.mx	\$50,165,788	0.52 %
94	COMPART	22S	AA (mex)	\$45,363,701	0.47 %
94	COMPART	24S	AA (mex)	\$25,152,406	0.26 %
Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo				\$940,355,289	9.81 %
CD	BANOB	20-2X	AAA (mex)	\$120,822,500	1.26 %
CD	NAFR	22S	AAA (mex)	\$111,131,101	1.16 %
CD	BANOB	22	AAA (mex)	\$80,645,508	0.84 %
CD	BACMEXT	21X	AAA (mex)	\$80,430,879	0.84 %
CD	NAFR	23S	AAA (mex)	\$80,352,516	0.84 %
CD	SHF	21-3	AAA (mex)	\$80,262,253	0.84 %
CD	BANOB	21-4X	AAA (mex)	\$80,187,944	0.84 %
CD	BACMEXT	22X	AAA (mex)	\$80,096,159	0.84 %
CD	NAFR	21X	AAA (mex)	\$75,503,605	0.79 %
CD	BACMEXT	24X	AAA (mex)	\$50,334,542	0.53 %
CD	NAFR	24S	AAA (mex)	\$50,311,712	0.53 %
CD	NAFR	23-3S	AAA (mex)	\$50,276,570	0.52 %


Swiss Certified
ISO 9001:2015

Signatory of:



T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
Certificados de Depósito				\$337,507,018	3.52 %
F	HSBCMX	24009	F1+ (mex)	\$201,547,734	2.10 %
F	BSCTIA	23025	F1+ (mex)	\$85,653,825	0.89 %
F	BANSAN	23030	F1+ (mex)	\$50,305,459	0.52 %
Pagaré con Rendimiento Liquidable al Vencimiento				\$1,302,009,167	13.59 %
I	BANOBRA	24141	F1+ (mex)	\$1,001,545,835	10.45 %
I	BACMEXT	24141	F1+ (mex)	\$300,463,332	3.14 %
Títulos de Organismos Financieros Multilaterales				\$223,317,540	2.33 %
J1	CABEI	1-21S	mxAAA	\$95,859,248	1.00 %
J1	BIDINV	1-24X	AAA (mex)	\$90,384,087	0.94 %
J1	CABEI	1-23S	mxAAA	\$37,074,205	0.39 %
Total Deuda Bancaria				\$4,722,645,691	49.28 %
Otros Títulos de Deuda					
Certificados Bursátiles Emitidos por Entidades o Instituciones del Gobierno Federal				\$694,877,262	7.25 %
95	FEFA	23V	mxAAA	\$151,483,491	1.58 %
95	FNCOT	23S	AAA (mex)	\$100,337,632	1.05 %
95	FNCOT	21G	AAA (mex)	\$90,918,983	0.95 %
95	FNCOT	21-2G	AAA (mex)	\$85,575,034	0.89 %
95	FNCOT	22S	AAA (mex)	\$85,440,655	0.89 %
95	FEFA	23-2V	mxAAA	\$50,401,736	0.53 %
95	FEFA	23G	mxAAA	\$40,217,222	0.42 %
95	FEFA	23-2	mxAAA	\$40,207,120	0.42 %
95	FEFA	24S	mxAAA	\$25,200,695	0.26 %
95	FEFA	19-3	mxAAA	\$25,094,694	0.26 %
Certificados Bursátiles Corporativos				\$3,487,772,067	36.40 %
91	ORBIA	22L	AAA (mex)	\$131,435,669	1.37 %
91	GAP	20	mxAAA	\$121,081,940	1.26 %
91	HERDEZ	22-2L	AA (mex)	\$116,060,726	1.21 %
91	MOLYMET	23	AAA (mex)	\$101,119,815	1.06 %
91	AMX	23-3	AAA (mex)	\$100,429,954	1.05 %
91	NM	24	mxAA+	\$100,245,355	1.05 %
91	BACHOCO	22	AAA (mex)	\$90,495,660	0.94 %
91	TIPMXCB	23-2	AAA (mex)	\$86,078,522	0.90 %
91	GRUMA	22	mxAA+	\$85,940,735	0.90 %
91	GPH	22	AAA (mex)	\$85,817,728	0.90 %
91	CETELEM	22-2	AAA (mex)	\$85,597,685	0.89 %
91	KIMBER	22-2	AAA (mex)	\$85,478,054	0.89 %
91	AC	22-2	AAA (mex)	\$85,360,916	0.89 %
91	MEGA	22	AAA (mex)	\$85,285,699	0.89 %
91	SORIANA	23	AAA (mex)	\$80,968,433	0.84 %
91	FEMSA	22L	AAA (mex)	\$80,695,818	0.84 %
91	OMA	22L	AAA (mex)	\$80,665,253	0.84 %
91	KOF	21-2L	Aaa.mx	\$80,642,315	0.84 %
91	BIMBO	23-2L	AAA (mex)	\$80,628,071	0.84 %
91	CETELEM	21-3	AAA (mex)	\$80,624,182	0.84 %
91	GMFIN	23	AAA (mex)	\$80,598,846	0.84 %
91	ACBE	21V	AAA (mex)	\$80,516,782	0.84 %
91	PCARFM	23	AAA (mex)	\$80,492,083	0.84 %
91	GAP	22	mxAAA	\$80,427,554	0.84 %
91	AMX	22	AAA (mex)	\$80,346,622	0.84 %
91	FERROMX	21-2	AAA (mex)	\$80,318,978	0.84 %
91	GCARSO	23	AAA (mex)	\$80,299,434	0.84 %
91	CETELEM	22-3	AAA (mex)	\$80,291,758	0.84 %
91	DAIMLER	23	mxAAA	\$80,208,338	0.84 %



Swiss
Certified

ISO 9001:2015

Signatory of:



T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
91	GAP	23L	mxAAA	\$80,192,114	0.84 %
91	AMX	23	AAA (mex)	\$80,189,049	0.84 %
91	VWLEASE	22	mxAAA	\$75,173,751	0.78 %
91	KOF	22X	mxAAA	\$68,562,113	0.72 %
91	BBPEN	21	AAA (mex)	\$60,597,456	0.63 %
91	GAP	21V	mxAAA	\$50,505,660	0.53 %
91	SIGMA	24	AAA (mex)	\$50,363,045	0.53 %
91	TOYOTA	23	AAA (mex)	\$50,282,895	0.52 %
91	GMFIN	24	AAA (mex)	\$50,200,333	0.52 %
91	GAP	24L	mxAAA	\$50,200,106	0.52 %
91	CEMEX	23L	AA (mex)	\$50,187,116	0.52 %
91	MEGA	24X	AAA (mex)	\$50,097,199	0.52 %
91	AMX	22-2	AAA (mex)	\$45,087,495	0.47 %
91	AC	24	AAA (mex)	\$40,132,923	0.42 %
91	ARRENCB	23	mxAAA	\$30,373,039	0.32 %
91	KOF	20-2	AAA (mex)	\$26,949,934	0.28 %
91	FUTILCB	23S	mxAAA	\$20,345,167	0.21 %
91	ACTINVR	24	AA- (mex)	\$20,090,639	0.21 %
91	BRX	22-2	B+ (mex)	\$20,089,108	0.21 %
Certificados Bursátiles Corporativos (Corto Plazo)				\$76,850,093	0.80 %
93	FORD	00824	F1+ (mex)	\$19,895,010	0.21 %
93	GMFIN	02824	F1+ (mex)	\$19,852,110	0.21 %
93	PCARFM	01224	F1+ (mex)	\$19,850,009	0.21 %
93	VWLEASE	02824	mxA-1+	\$9,925,760	0.10 %
93	AMX	02524	F1+ (mex)	\$7,327,204	0.08 %
Total Otros Títulos de Deuda				\$4,259,499,422	44.45 %
TOTAL DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES				\$8,982,145,113	93.73 %
TOTAL DE INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS				\$8,982,145,113	93.73 %
OPERACIONES DE REPORTE REPORTADOR					
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Semestral)				\$428,868,585	4.48 %
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	\$428,868,585	4.48 %
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)				\$171,985,256	1.79 %
IQ	BPAG91	250102	AAA(mex)	\$171,985,256	1.79 %
TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE				\$600,853,841	6.27 %
TOTAL DE CARTERA:				\$9,582,998,955	100.00%
Límite Máximo de VaR: 0.350%			VaR Promedio: 0.0330%		
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.					
TV	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
Valores Respaldados por Activos.					
91	ARRENCB	23	mxAAA	\$30,373,039	0.32 %
91	FUTILCB	23S	mxAAA	\$20,345,167	0.21 %
91	TIPMXCB	23-2	AAA (mex)	\$86,078,522	0.90 %
Total:				\$136,796,728	1.43%
"El riesgo en los instrumentos financieros derivados, certificados bursátiles fiduciarios y valores estructurados o respaldados por activos (en caso de tenerlos en el fondo) consiste en movimientos adversos en los factores de riesgo que afecten instrumento adquirido. El riesgo se considera alto debido a la existencia de factores de riesgo implícitos como movimiento de tasas de interés, tipos de cambio o inflación, etc"					


Swiss Certified
ISO 9001:2015

Signatory of:

