

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

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
INVERSIONES EN VALORES					
TÍTULOS PARA NEGOCIAR					
Deuda Bancaria					
Certificados Bursátiles Bancarios				\$2,189,696,783	27.89 %
94	BLADEX	19	AAA (mex)	\$228,877,187	2.92 %
94	HSBC	19-2	AAA (mex)	\$170,637,638	2.17 %
94	BSMX	19	AAA (mex)	\$150,475,737	1.92 %
94	BACOMER	17-2	AAA (mex)	\$136,068,800	1.73 %
94	BSMX	18	AAA (mex)	\$126,822,932	1.62 %
94	BACTIN	19-2	HR AA-	\$120,451,627	1.53 %
94	BINBUR	18	mxAAA	\$120,300,118	1.53 %
94	SCOTIAB	18	AAA (mex)	\$115,323,127	1.47 %
94	SCOTIAB	19	AAA (mex)	\$110,562,150	1.41 %
94	SCOTIAB	19-2	AAA (mex)	\$110,150,171	1.40 %
94	BACOMER	20-2	AAA (mex)	\$105,466,356	1.34 %
94	BANORTE	19	mxAAA	\$100,182,245	1.28 %
94	BACOMER	19	AAA (mex)	\$82,551,630	1.05 %
94	BACTIN	19	HR AA-	\$80,330,826	1.02 %
94	SCOTIAB	17-2	AAA (mex)	\$75,400,340	0.96 %
94	COMPART	21S	AA (mex)	\$75,164,531	0.96 %
94	BSMX	21	AAA (mex)	\$75,071,645	0.96 %
94	BLADEX	20	AAA (mex)	\$55,564,417	0.71 %
94	BACOMER	20	AAA (mex)	\$55,152,866	0.70 %
94	BANORTE	19-2	mxAAA	\$50,148,025	0.64 %
94	COMPART	19	AA (mex)	\$44,994,415	0.57 %
Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo				\$371,088,538	4.73 %
CD	BANOB	21-4X	AAA (mex)	\$80,322,310	1.02 %
CD	BACMEXT	21X	AAA (mex)	\$80,124,940	1.02 %
CD	SHF	21-3	AAA (mex)	\$80,037,936	1.02 %
CD	NAFR	21X	mxAAA	\$75,137,982	0.96 %
CD	NAFR	17S	AAA (mex)	\$55,465,370	0.71 %
Certificados de Depósito				\$80,038,423	1.02 %
F	BSCTIA	21002	F1+ (mex)	\$80,038,423	1.02 %
Pagaré con Rendimiento Liquidable al Vencimiento				\$500,226,250	6.37 %
I	NAFIN	22011	F1+ (mex)	\$500,226,250	6.37 %
Títulos de Organismos Financieros Multilaterales				\$465,220,335	5.93 %
JI	CABEI	1-19	mxAAA	\$100,491,721	1.28 %
JI	BIDINV	1-20	mxAAA	\$100,339,517	1.28 %
JI	CABEI	1-21S	mxAAA	\$95,308,090	1.21 %
JI	BIDINV	1-21G	mxAAA	\$85,049,169	1.08 %
JI	CABEI	2-19	mxAAA	\$55,362,342	0.71 %
JI	CABEI	1-20	mxAAA	\$28,669,496	0.37 %
Total Deuda Bancaria				\$3,606,270,329	45.94 %
Otros Títulos de Deuda					
Certificados Bursátiles Emitidos por Entidades o Instituciones del Gobierno Federal				\$545,300,703	6.95 %
95	FNCOT	19	AAA (mex)	\$100,378,475	1.28 %



T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
95	FEFA	19V	mxAAA	\$100,282,619	1.28 %
95	FNCOT	21G	AAA (mex)	\$80,502,326	1.03 %
95	FNCOT	21-2G	AAA (mex)	\$75,141,767	0.96 %
95	FEFA	20G	mxAAA	\$50,250,166	0.64 %
95	FEFA	20-3	mxAAA	\$50,173,328	0.64 %
95	FEFA	19-2	mxAAA	\$50,054,220	0.64 %
95	FEFA	19-3	mxAAA	\$25,102,094	0.32 %
95	FEFA	17-5	mxAAA	\$13,415,708	0.17 %
Certificados Bursátiles Corporativos				\$2,638,550,436	33.61 %
91	SORIANA	20	AA+ (mex)	\$150,818,536	1.92 %
91	LIVEPOL	17-2	AAA (mex)	\$130,428,450	1.66 %
91	BACHOCO	17	AAA (mex)	\$130,073,428	1.66 %
91	NRF	19	Aa3.mx	\$120,456,694	1.53 %
91	GAP	20	mxAAA	\$119,334,667	1.52 %
91	GRUMA	18	mxAAA+	\$106,316,948	1.35 %
91	GMXT	17-2	AAA (mex)	\$101,708,754	1.30 %
91	NM	21	mxAAA+	\$100,469,698	1.28 %
91	GCARSO	20	AAA (mex)	\$100,211,807	1.28 %
91	GMXT	19-2	AAA (mex)	\$99,399,703	1.27 %
91	GPH	19	AAA (mex)	\$90,900,246	1.16 %
91	TIPMXCB	20-2	AAA (mex)	\$85,632,739	1.09 %
91	LALA	18-2	HR AA-	\$85,065,053	1.08 %
91	ACBE	17-2	AAA (mex)	\$82,894,647	1.06 %
91	KOF	21-2L	Aaa.mx	\$80,200,855	1.02 %
91	CETELEM	21-3	AAA (mex)	\$80,182,877	1.02 %
91	ACBE	21V	AAA (mex)	\$80,165,990	1.02 %
91	CETELEM	19	AAA (mex)	\$80,165,739	1.02 %
91	FERROMX	21-2	AAA (mex)	\$80,102,805	1.02 %
91	GAP	19	mxAAA	\$80,032,950	1.02 %
91	VWLEASE	19-2	mxAAA	\$70,363,151	0.90 %
91	MOLYMET	21	AAA (mex)	\$70,282,708	0.90 %
91	BBPEN	21	AAA (mex)	\$60,210,348	0.77 %
91	GAP	17	mxAAA	\$50,219,649	0.64 %
91	GAP	21V	mxAAA	\$50,180,286	0.64 %
91	FUNO	21-2X	AAA (mex)	\$50,146,785	0.64 %
91	KOF	17-2	mxAAA	\$46,358,624	0.59 %
91	FUNO	18	AAA (mex)	\$45,809,669	0.58 %
91	ARRENCB	21	mxAAA	\$45,746,374	0.58 %
91	GAP	17-2	mxAAA	\$40,073,391	0.51 %
91	KOF	20-2	AAA (mex)	\$26,641,617	0.34 %
91	ACTINVR	19-2	AA- (mex)	\$24,104,130	0.31 %
91	LALA	20-2	HR AA-	\$20,115,183	0.26 %
91	CRELCB	19	AAA (mex)	\$14,178,536	0.18 %
91	VWLEASE	18	mxAAA	\$10,037,717	0.13 %
91	ACTINVR	19	AA- (mex)	\$10,024,605	0.13 %
91	ABCCB	18	mxAAA	\$8,387,246	0.11 %
91	FUTILCB	19	mxAAA	\$8,026,696	0.10 %
91	CREALCB	17	AAA (mex)	\$3,081,135	0.04 %
Certificados Bursátiles Corporativos (Corto Plazo)				\$25,047,493	0.32 %
93	CETELEM	00421	F1+ (mex)	\$25,047,493	0.32 %
Total Otros Títulos de Deuda				\$3,208,898,632	40.87 %
TOTAL DE TÍTULOS PARA NEGOCIAR				\$6,815,168,961	86.81 %
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES				\$6,815,168,961	86.81 %
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADOR					



T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)				\$535,411,075	6.82 %
IQ	BPAG91	260507	AAA(mex)	\$428,879,709	5.46 %
IQ	BPAG91	260507	AAA(mex)	\$106,531,366	1.36 %
Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo				\$500,229,094	6.37 %
CD	BANOB	21X	AAA (mex)	\$250,114,557	3.19 %
CD	SHF	21	AAA (mex)	\$250,114,537	3.19 %
TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTO				\$1,035,640,169	13.19 %
TOTAL DE CARTERA:				\$7,850,809,130	100.00%

Límite Máximo de VaR: 0.350%

VaR Promedio: 0.0123%

Valor en Riesgo (VaR) Supuestos y Metodología: Horizonte de tiempo de un día y con nivel de confianza al 95% a dos cosas basada en una simulación histórica no paramétrica de 500 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	CREALCB	17	AAA (mex)	\$3,081,135	0.04 %
91	ARRENCB	21	mxAAA	\$45,746,374	0.58 %
91	ABCCB	18	mxAAA	\$8,387,246	0.11 %
91	FUTILCB	19	mxAAA	\$8,026,696	0.10 %
91	CRELCB	19	AAA (mex)	\$14,178,536	0.18 %
91	TIPMXCB	20-2	AAA (mex)	\$85,632,739	1.09 %
Total:				\$165,052,726	2.10%

"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"

