

Composición de la Cartera de Inversión al 30 de junio de 2022.

NTEGUB+					
Fondo Banorte 1, 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 VALORES					
TÍTULOS PARA NEGOCIAR					
Deuda Gubernamental					
Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LD				\$1,535,967,988	13.81 %
LD	BONDESD	250619	AAA(mex)	\$129,572,703	1.17 %
LD	BONDESD	250416	AAA(mex)	\$89,853,485	0.81 %
LD	BONDESD	251016	AAA(mex)	\$89,525,306	0.80 %
LD	BONDESD	231221	AAA(mex)	\$80,424,374	0.72 %
LD	BONDESD	230629	AAA(mex)	\$79,963,550	0.72 %
LD	BONDESD	250814	AAA(mex)	\$79,722,291	0.72 %
LD	BONDESD	230105	AAA(mex)	\$70,098,212	0.63 %
LD	BONDESD	240404	AAA(mex)	\$69,836,163	0.63 %
LD	BONDESD	230831	AAA(mex)	\$60,200,709	0.54 %
LD	BONDESD	241219	AAA(mex)	\$60,035,582	0.54 %
LD	BONDESD	240201	AAA(mex)	\$59,977,016	0.54 %
LD	BONDESD	240822	AAA(mex)	\$50,845,428	0.46 %
LD	BONDESD	240425	AAA(mex)	\$49,951,389	0.45 %
LD	BONDESD	250220	AAA(mex)	\$49,939,592	0.45 %
LD	BONDESD	240530	AAA(mex)	\$49,868,619	0.45 %
LD	BONDESD	220908	AAA(mex)	\$45,819,696	0.41 %
LD	BONDESD	230309	AAA(mex)	\$40,282,512	0.36 %
LD	BONDESD	230706	AAA(mex)	\$40,148,177	0.36 %
LD	BONDESD	220714	AAA(mex)	\$40,121,442	0.36 %
LD	BONDESD	240801	AAA(mex)	\$40,044,962	0.36 %
LD	BONDESD	231207	AAA(mex)	\$39,997,763	0.36 %
LD	BONDESD	260212	AAA(mex)	\$39,928,287	0.36 %
LD	BONDESD	240627	AAA(mex)	\$39,889,572	0.36 %
LD	BONDESD	251211	AAA(mex)	\$39,775,880	0.36 %
LD	BONDESD	230330	AAA(mex)	\$30,183,508	0.27 %
LD	BONDESD	231101	AAA(mex)	\$30,047,719	0.27 %
LD	BONDESD	240229	AAA(mex)	\$19,987,928	0.18 %
LD	BONDESD	260806	AAA(mex)	\$19,926,123	0.18 %
Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LF				\$1,186,657,551	10.67 %
LF	BONDESF	231130	AAA(mex)	\$180,266,897	1.62 %
LF	BONDESF	241003	AAA(mex)	\$139,932,958	1.26 %
LF	BONDESF	241128	AAA(mex)	\$119,897,688	1.08 %
LF	BONDESF	261001	AAA(mex)	\$119,457,920	1.07 %
LF	BONDESF	230330	AAA(mex)	\$90,112,405	0.81 %
LF	BONDESF	240201	AAA(mex)	\$89,965,724	0.81 %
LF	BONDESF	231005	AAA(mex)	\$80,142,375	0.72 %
LF	BONDESF	230302	AAA(mex)	\$73,094,457	0.66 %
LF	BONDESF	250130	AAA(mex)	\$59,850,424	0.54 %
LF	BONDESF	250227	AAA(mex)	\$59,830,604	0.54 %
LF	BONDESF	270225	AAA(mex)	\$59,576,221	0.54 %
LF	BONDESF	250327	AAA(mex)	\$49,853,016	0.45 %
LF	BONDESF	270128	AAA(mex)	\$49,656,686	0.45 %
LF	BONDESF	230202	AAA(mex)	\$15,020,176	0.14 %



T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Mensual)				\$549,958,662	4.95 %
IM	BPAG28	230511	AAA(mex)	\$90,314,590	0.81 %
IM	BPAG28	241107	AAA(mex)	\$79,795,621	0.72 %
IM	BPAG28	220811	AAA(mex)	\$70,185,829	0.63 %
IM	BPAG28	230810	AAA(mex)	\$70,102,974	0.63 %
IM	BPAG28	240808	AAA(mex)	\$59,953,931	0.54 %
IM	BPAG28	250206	AAA(mex)	\$59,731,078	0.54 %
IM	BPAG28	240208	AAA(mex)	\$49,895,543	0.45 %
IM	BPAG28	231109	AAA(mex)	\$39,989,397	0.36 %
IM	BPAG28	230209	AAA(mex)	\$29,989,699	0.27 %
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Semestral)				\$346,285,018	3.11 %
IS	BPA182	220908	AAA(mex)	\$81,633,799	0.73 %
IS	BPA182	240307	AAA(mex)	\$51,325,328	0.46 %
IS	BPA182	230907	AAA(mex)	\$40,981,336	0.37 %
IS	BPA182	250306	AAA(mex)	\$40,685,834	0.37 %
IS	BPA182	270401	AAA(mex)	\$40,406,288	0.36 %
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	\$30,653,925	0.28 %
IS	BPA182	251002	AAA(mex)	\$30,360,957	0.27 %
IS	BPA182	280412	AAA(mex)	\$30,237,551	0.27 %
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)				\$515,263,342	4.63 %
IQ	BPAG91	240111	AAA(mex)	\$60,760,454	0.55 %
IQ	BPAG91	250430	AAA(mex)	\$60,400,824	0.54 %
IQ	BPAG91	221229	AAA(mex)	\$51,983,903	0.47 %
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	\$40,450,833	0.36 %
IQ	BPAG91	230427	AAA(mex)	\$40,446,821	0.36 %
IQ	BPAG91	240502	AAA(mex)	\$40,328,121	0.36 %
IQ	BPAG91	270107	AAA(mex)	\$40,312,393	0.36 %
IQ	BPAG91	260507	AAA(mex)	\$40,142,600	0.36 %
IQ	BPAG91	230831	AAA(mex)	\$40,139,648	0.36 %
IQ	BPAG91	240829	AAA(mex)	\$40,071,850	0.36 %
IQ	BPAG91	250904	AAA(mex)	\$39,971,756	0.36 %
IQ	BPAG91	250102	AAA(mex)	\$20,254,139	0.18 %
Total Deuda Gubernamental				\$4,134,132,561	37.17 %
TOTAL DE TÍTULOS PARA NEGOCIAR				\$4,134,132,561	37.17 %
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES				\$4,134,132,561	37.17 %
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADOR					
Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LD				\$2,016,804,830	18.13 %
LD	BONDESD	230309	AAA(mex)	\$1,003,102,007	9.02 %
LD	BONDESD	230706	AAA(mex)	\$524,047,854	4.71 %
LD	BONDESD	250814	AAA(mex)	\$489,654,969	4.40 %
Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LF				\$3,500,760,217	31.48 %
LF	BONDESF	270318	AAA(mex)	\$3,500,760,217	31.48 %
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)				\$1,469,499,263	13.21 %
IQ	BPAG91	240502	AAA(mex)	\$1,469,499,263	13.21 %
TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE				\$6,987,064,310	62.83 %
TOTAL DE CARTERA:				\$11,121,196,871	100.00%
Límite Máximo de VaR: 0.005%				VaR Promedio: 0.0027%	
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.					
El Fondo no realizará estrategias temporales de inversión					

