

**Composición de la Cartera de Inversión al 31 de mayo de 2024.**

<b>NTEGUB+</b>					
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
<b>INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS</b>					
<b>INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES</b>					
<b>Deuda Gubernamental</b>					
<b>Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LD</b>				<b>\$692,994,269</b>	<b>6.45 %</b>
LD	BONDESD	250619	AAA(mex)	\$130,308,209	1.21 %
LD	BONDESD	250416	AAA(mex)	\$90,421,449	0.84 %
LD	BONDESD	251016	AAA(mex)	\$89,976,578	0.84 %
LD	BONDESD	250814	AAA(mex)	\$80,171,819	0.75 %
LD	BONDESD	241219	AAA(mex)	\$60,435,316	0.56 %
LD	BONDESD	240822	AAA(mex)	\$51,054,634	0.48 %
LD	BONDESD	250220	AAA(mex)	\$50,248,520	0.47 %
LD	BONDESD	240801	AAA(mex)	\$40,302,395	0.37 %
LD	BONDESD	240627	AAA(mex)	\$40,047,047	0.37 %
LD	BONDESD	251211	AAA(mex)	\$39,981,780	0.37 %
LD	BONDESD	260806	AAA(mex)	\$20,046,522	0.19 %
<b>Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LF</b>				<b>\$3,275,142,617</b>	<b>30.47 %</b>
LF	BONDESF	261001	AAA(mex)	\$230,530,162	2.15 %
LF	BONDESF	261203	AAA(mex)	\$149,978,954	1.40 %
LF	BONDESF	261231	AAA(mex)	\$149,953,136	1.40 %
LF	BONDESF	280615	AAA(mex)	\$149,599,535	1.39 %
LF	BONDESF	270422	AAA(mex)	\$139,885,147	1.30 %
LF	BONDESF	241128	AAA(mex)	\$120,618,317	1.12 %
LF	BONDESF	250102	AAA(mex)	\$120,551,839	1.12 %
LF	BONDESF	260423	AAA(mex)	\$120,138,868	1.12 %
LF	BONDESF	250724	AAA(mex)	\$120,015,995	1.12 %
LF	BONDESF	250130	AAA(mex)	\$110,315,895	1.03 %
LF	BONDESF	271014	AAA(mex)	\$109,576,812	1.02 %
LF	BONDESF	250116	AAA(mex)	\$100,722,109	0.94 %
LF	BONDESF	260604	AAA(mex)	\$100,516,454	0.94 %
LF	BONDESF	251002	AAA(mex)	\$100,406,744	0.93 %
LF	BONDESF	270114	AAA(mex)	\$100,398,460	0.93 %
LF	BONDESF	250403	AAA(mex)	\$100,063,942	0.93 %
LF	BONDESF	250327	AAA(mex)	\$90,250,761	0.84 %
LF	BONDESF	250619	AAA(mex)	\$80,199,345	0.75 %
LF	BONDESF	260226	AAA(mex)	\$70,099,100	0.65 %
LF	BONDESF	251023	AAA(mex)	\$60,370,099	0.56 %
LF	BONDESF	250227	AAA(mex)	\$60,169,013	0.56 %
LF	BONDESF	250424	AAA(mex)	\$60,162,514	0.56 %
LF	BONDESF	250522	AAA(mex)	\$60,148,673	0.56 %
LF	BONDESF	251204	AAA(mex)	\$60,106,772	0.56 %
LF	BONDESF	240725	AAA(mex)	\$60,066,857	0.56 %
LF	BONDESF	270225	AAA(mex)	\$59,965,032	0.56 %
LF	BONDESF	241024	AAA(mex)	\$50,368,853	0.47 %
LF	BONDESF	250313	AAA(mex)	\$50,354,956	0.47 %
LF	BONDESF	270318	AAA(mex)	\$50,073,651	0.47 %
LF	BONDESF	260521	AAA(mex)	\$50,052,063	0.47 %
LF	BONDESF	270930	AAA(mex)	\$50,025,361	0.47 %
LF	BONDESF	270128	AAA(mex)	\$49,979,688	0.47 %



T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
LF	BONDESF	280323	AAA(mex)	\$49,885,750	0.46 %
LF	BONDESF	290125	AAA(mex)	\$49,818,727	0.46 %
LF	BONDESF	241003	AAA(mex)	\$40,210,446	0.37 %
LF	BONDESF	270617	AAA(mex)	\$29,965,483	0.28 %
LF	BONDESF	280127	AAA(mex)	\$29,940,151	0.28 %
LF	BONDESF	320415	AAA(mex)	\$29,735,658	0.28 %
LF	BONDESF	240815	AAA(mex)	\$20,044,098	0.19 %
LF	BONDESF	270819	AAA(mex)	\$19,927,982	0.19 %
LF	BONDESF	260108	AAA(mex)	\$9,995,082	0.09 %
LF	BONDESF	291004	AAA(mex)	\$9,954,133	0.09 %
<b>Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LG</b>				<b>\$55,225,489</b>	<b>0.51 %</b>
LG	BONDESG	250710	AAA(mex)	\$35,156,116	0.33 %
LG	BONDESG	260319	AAA(mex)	\$10,035,330	0.09 %
LG	BONDESG	270506	AAA(mex)	\$10,034,043	0.09 %
<b>Bonos de Protección al Ahorro (Pago Mensual)</b>				<b>\$672,142,608</b>	<b>6.25 %</b>
IM	BPAG28	250206	AAA(mex)	\$110,065,293	1.02 %
IM	BPAG28	250508	AAA(mex)	\$100,691,268	0.94 %
IM	BPAG28	260507	AAA(mex)	\$90,467,275	0.84 %
IM	BPAG28	241107	AAA(mex)	\$80,234,843	0.75 %
IM	BPAG28	261105	AAA(mex)	\$69,980,404	0.65 %
IM	BPAG28	240808	AAA(mex)	\$60,320,904	0.56 %
IM	BPAG28	270506	AAA(mex)	\$50,166,075	0.47 %
IM	BPAG28	260806	AAA(mex)	\$50,124,415	0.47 %
IM	BPAG28	250807	AAA(mex)	\$30,122,591	0.28 %
IM	BPAG28	260205	AAA(mex)	\$29,969,540	0.28 %
<b>Bonos de Protección al Ahorro (Pago Semestral)</b>				<b>\$356,243,477</b>	<b>3.31 %</b>
IS	BPA182	290322	AAA(mex)	\$71,832,658	0.67 %
IS	BPA182	280412	AAA(mex)	\$60,598,759	0.56 %
IS	BPA182	250306	AAA(mex)	\$41,049,883	0.38 %
IS	BPA182	270401	AAA(mex)	\$40,608,338	0.38 %
IS	BPA182	300328	AAA(mex)	\$40,453,450	0.38 %
IS	BPA182	301010	AAA(mex)	\$40,263,112	0.37 %
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	\$30,902,246	0.29 %
IS	BPA182	251002	AAA(mex)	\$30,535,031	0.28 %
<b>Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)</b>				<b>\$510,695,882</b>	<b>4.75 %</b>
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	\$81,351,023	0.76 %
IQ	BPAG91	270506	AAA(mex)	\$70,318,648	0.65 %
IQ	BPAG91	250430	AAA(mex)	\$60,541,276	0.56 %
IQ	BPAG91	250904	AAA(mex)	\$41,052,168	0.38 %
IQ	BPAG91	280907	AAA(mex)	\$40,810,340	0.38 %
IQ	BPAG91	270107	AAA(mex)	\$40,531,514	0.38 %
IQ	BPAG91	260507	AAA(mex)	\$40,228,680	0.37 %
IQ	BPAG91	240829	AAA(mex)	\$40,046,076	0.37 %
IQ	BPAG91	280511	AAA(mex)	\$40,036,101	0.37 %
IQ	BPAG91	280106	AAA(mex)	\$35,422,204	0.33 %
IQ	BPAG91	250102	AAA(mex)	\$20,357,852	0.19 %
<b>Certificados de la Tesorería de la Federación</b>				<b>\$18,122,494</b>	<b>0.17 %</b>
BI	CETES	250515	AAA(mex)	\$18,122,494	0.17 %
<b>Total Deuda Gubernamental</b>				<b>\$5,580,566,836</b>	<b>51.93 %</b>
<b>TOTAL DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES</b>				<b>\$5,580,566,836</b>	<b>51.93 %</b>
<b>TOTAL DE INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS</b>				<b>\$5,580,566,836</b>	<b>51.93 %</b>
<b>OPERACIONES DE REPORTE REPORTADOR</b>					

T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
<b>Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LF</b>				<b>\$3,508,242,033</b>	<b>32.64 %</b>
LF	BONDESF	250619	AAA(mex)	\$1,865,647,330	17.36 %
LF	BONDESF	260423	AAA(mex)	\$1,637,590,128	15.24 %
LF	BONDESF	280615	AAA(mex)	\$5,004,575	0.05 %
<b>Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)</b>				<b>\$1,658,505,393</b>	<b>15.43 %</b>
IQ	BPAG91	260903	AAA(mex)	\$958,055,758	8.91 %
IQ	BPAG91	250430	AAA(mex)	\$700,449,635	6.52 %
<b>TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE</b>				<b>\$5,166,747,426</b>	<b>48.07 %</b>
<b>TOTAL DE CARTERA:</b>				<b>\$10,747,314,262</b>	<b>100.00%</b>
<b>Límite Máximo de VaR: 0.005%</b>				<b>VaR Promedio: 0.0029%</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 501 observaciones.					
<b>El Fondo no realizará estrategias temporales de inversión</b>					

