

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

NTEGUB					
Fondo Banorte 3, S.A de C.V. Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda					
Categoría: Corto Plazo Gubernamental					
Calificación: AAAf/S1(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				\$13,610,068,414	27.31 %
LD	BONDESD	220127	AAA(mex)	\$2,361,326,788	4.74 %
LD	BONDESD	220421	AAA(mex)	\$2,345,948,107	4.71 %
LD	BONDESD	220721	AAA(mex)	\$1,296,288,833	2.60 %
LD	BONDESD	221110	AAA(mex)	\$1,003,033,630	2.01 %
LD	BONDESD	230330	AAA(mex)	\$837,078,123	1.68 %
LD	BONDESD	220512	AAA(mex)	\$721,039,399	1.45 %
LD	BONDESD	230629	AAA(mex)	\$580,644,954	1.17 %
LD	BONDESD	220616	AAA(mex)	\$554,648,801	1.11 %
LD	BONDESD	230105	AAA(mex)	\$441,244,056	0.89 %
LD	BONDESD	220113	AAA(mex)	\$441,197,636	0.89 %
LD	BONDESD	220203	AAA(mex)	\$431,567,535	0.87 %
LD	BONDESD	240201	AAA(mex)	\$405,276,494	0.81 %
LD	BONDESD	220428	AAA(mex)	\$391,360,016	0.79 %
LD	BONDESD	221013	AAA(mex)	\$320,996,982	0.64 %
LD	BONDESD	220317	AAA(mex)	\$290,448,981	0.58 %
LD	BONDESD	230309	AAA(mex)	\$230,371,839	0.46 %
LD	BONDESD	240530	AAA(mex)	\$171,834,901	0.34 %
LD	BONDESD	240229	AAA(mex)	\$170,089,515	0.34 %
LD	BONDESD	220908	AAA(mex)	\$170,020,043	0.34 %
LD	BONDESD	240404	AAA(mex)	\$169,921,795	0.34 %
LD	BONDESD	240627	AAA(mex)	\$139,865,023	0.28 %
LD	BONDESD	241024	AAA(mex)	\$123,195,105	0.25 %
LD	BONDESD	230706	AAA(mex)	\$12,669,858	0.03 %
Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LF				\$3,027,490,496	6.08 %
LF	BONDESF	231005	AAA(mex)	\$748,755,323	1.50 %
LF	BONDESF	221006	AAA(mex)	\$700,041,377	1.40 %
LF	BONDESF	221201	AAA(mex)	\$699,950,111	1.40 %
LF	BONDESF	231130	AAA(mex)	\$698,739,055	1.40 %
LF	BONDESF	221103	AAA(mex)	\$180,004,630	0.36 %
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Mensual)				\$3,541,296,444	7.11 %
IM	BPAG28	230209	AAA(mex)	\$510,609,205	1.02 %
IM	BPAG28	220811	AAA(mex)	\$490,015,724	0.98 %
IM	BPAG28	230810	AAA(mex)	\$369,426,741	0.74 %
IM	BPAG28	220512	AAA(mex)	\$350,479,077	0.70 %
IM	BPAG28	240509	AAA(mex)	\$344,289,345	0.69 %
IM	BPAG28	240808	AAA(mex)	\$343,797,585	0.69 %
IM	BPAG28	240208	AAA(mex)	\$316,914,235	0.64 %
IM	BPAG28	230511	AAA(mex)	\$269,966,623	0.54 %
IM	BPAG28	221110	AAA(mex)	\$250,686,148	0.50 %
IM	BPAG28	241107	AAA(mex)	\$174,818,462	0.35 %
IM	BPAG28	220210	AAA(mex)	\$120,293,299	0.24 %
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)				\$753,111,208	1.51 %
IQ	BPAG91	230427	AAA(mex)	\$252,045,725	0.51 %



T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
IQ	BPAG91	220825	AAA(mex)	\$251,168,755	0.50 %
IQ	BPAG91	221229	AAA(mex)	\$249,896,728	0.50 %
Total Deuda Gubernamental				\$20,931,966,562	42.00 %
TOTAL DE TÍTULOS PARA NEGOCIAR				\$20,931,966,562	42.00 %
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES				\$20,931,966,562	42.00 %
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADOR					
Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LD				\$16,620,681,824	33.35 %
LD	BONDESD	241219	AAA(mex)	\$5,620,046,106	11.28 %
LD	BONDESD	250220	AAA(mex)	\$2,630,260,786	5.28 %
LD	BONDESD	250220	AAA(mex)	\$1,948,095,508	3.91 %
LD	BONDESD	250416	AAA(mex)	\$1,566,183,633	3.14 %
LD	BONDESD	240822	AAA(mex)	\$998,570,067	2.00 %
LD	BONDESD	231221	AAA(mex)	\$848,826,586	1.70 %
LD	BONDESD	241024	AAA(mex)	\$844,811,684	1.70 %
LD	BONDESD	240801	AAA(mex)	\$616,988,054	1.24 %
LD	BONDESD	230706	AAA(mex)	\$499,945,552	1.00 %
LD	BONDESD	251016	AAA(mex)	\$300,136,195	0.60 %
LD	BONDESD	221013	AAA(mex)	\$276,726,260	0.56 %
LD	BONDESD	230504	AAA(mex)	\$271,058,315	0.54 %
LD	BONDESD	250220	AAA(mex)	\$199,033,078	0.40 %
Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LF				\$1,500,681,086	3.01 %
LF	BONDESF	241128	AAA(mex)	\$500,227,047	1.00 %
LF	BONDESF	241128	AAA(mex)	\$500,227,047	1.00 %
LF	BONDESF	261203	AAA(mex)	\$500,226,992	1.00 %
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Mensual)				\$1,400,252,866	2.81 %
IM	BPAG28	240808	AAA(mex)	\$500,227,033	1.00 %
IM	BPAG28	240808	AAA(mex)	\$500,227,033	1.00 %
IM	BPAG28	240808	AAA(mex)	\$200,090,773	0.40 %
IM	BPAG28	241107	AAA(mex)	\$199,708,027	0.40 %
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Semestral)				\$2,501,131,223	5.02 %
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	\$1,117,059,168	2.24 %
IS	BPA182	270930	AAA(mex)	\$908,724,684	1.82 %
IS	BPA182	240307	AAA(mex)	\$475,347,371	0.95 %
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)				\$6,877,906,564	13.80 %
IQ	BPAG91	240111	AAA(mex)	\$2,654,616,197	5.33 %
IQ	BPAG91	240829	AAA(mex)	\$1,924,855,835	3.86 %
IQ	BPAG91	260903	AAA(mex)	\$1,396,088,474	2.80 %
IQ	BPAG91	240829	AAA(mex)	\$902,346,058	1.81 %
TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE				\$28,900,653,563	58.00 %
TOTAL DE CARTERA:				\$49,832,620,125	100.00%
Límite Máximo de VaR: 0.010%				VaR Promedio: 0.0018%	
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.					

