

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

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 INSTRUMENTOS FINANCIEROS					
INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES					
Deuda Gubernamental					
Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LD				\$570,217,191	0.83 %
LD	BONDESD	250619	AAA(mex)	\$228,540,552	0.33 %
LD	BONDESD	240801	AAA(mex)	\$201,511,974	0.29 %
LD	BONDESD	240627	AAA(mex)	\$140,164,665	0.20 %
Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LF				\$23,766,351,284	34.69 %
LF	BONDESF	250327	AAA(mex)	\$2,777,215,160	4.05 %
LF	BONDESF	260226	AAA(mex)	\$1,552,194,351	2.27 %
LF	BONDESF	251002	AAA(mex)	\$1,455,936,143	2.12 %
LF	BONDESF	251204	AAA(mex)	\$1,402,491,356	2.05 %
LF	BONDESF	250724	AAA(mex)	\$1,380,183,940	2.01 %
LF	BONDESF	251023	AAA(mex)	\$1,378,450,585	2.01 %
LF	BONDESF	260423	AAA(mex)	\$1,195,638,329	1.74 %
LF	BONDESF	250227	AAA(mex)	\$1,076,548,500	1.57 %
LF	BONDESF	260115	AAA(mex)	\$905,319,693	1.32 %
LF	BONDESF	241003	AAA(mex)	\$884,629,812	1.29 %
LF	BONDESF	261001	AAA(mex)	\$872,005,394	1.27 %
LF	BONDESF	250424	AAA(mex)	\$857,069,453	1.25 %
LF	BONDESF	250116	AAA(mex)	\$856,137,927	1.25 %
LF	BONDESF	260604	AAA(mex)	\$753,873,405	1.10 %
LF	BONDESF	260108	AAA(mex)	\$729,640,986	1.06 %
LF	BONDESF	250130	AAA(mex)	\$601,723,062	0.88 %
LF	BONDESF	250403	AAA(mex)	\$498,568,691	0.73 %
LF	BONDESF	250619	AAA(mex)	\$481,196,069	0.70 %
LF	BONDESF	241024	AAA(mex)	\$413,024,595	0.60 %
LF	BONDESF	240725	AAA(mex)	\$400,445,716	0.58 %
LF	BONDESF	270128	AAA(mex)	\$399,837,500	0.58 %
LF	BONDESF	250102	AAA(mex)	\$252,035,583	0.37 %
LF	BONDESF	260521	AAA(mex)	\$250,260,315	0.37 %
LF	BONDESF	250313	AAA(mex)	\$221,561,804	0.32 %
LF	BONDESF	250522	AAA(mex)	\$220,545,136	0.32 %
LF	BONDESF	270930	AAA(mex)	\$200,101,442	0.29 %
LF	BONDESF	270617	AAA(mex)	\$199,769,888	0.29 %
LF	BONDESF	271014	AAA(mex)	\$189,269,040	0.28 %
LF	BONDESF	241128	AAA(mex)	\$160,824,422	0.23 %
LF	BONDESF	270114	AAA(mex)	\$150,597,690	0.22 %
LF	BONDESF	240815	AAA(mex)	\$150,331,285	0.22 %
LF	BONDESF	270422	AAA(mex)	\$149,876,943	0.22 %
LF	BONDESF	241107	AAA(mex)	\$100,304,352	0.15 %
LF	BONDESF	261203	AAA(mex)	\$99,985,969	0.15 %
LF	BONDESF	261231	AAA(mex)	\$99,968,757	0.15 %
LF	BONDESF	270225	AAA(mex)	\$99,941,720	0.15 %
LF	BONDESF	280127	AAA(mex)	\$99,800,503	0.15 %
LF	BONDESF	290125	AAA(mex)	\$99,637,453	0.15 %
LF	BONDESF	290419	AAA(mex)	\$79,680,094	0.12 %
LF	BONDESF	270819	AAA(mex)	\$49,819,955	0.07 %



Swiss Certified

ISO 9001:2015

Signatory of:



T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
LF	BONDEF	291004	AAA(mex)	\$19,908,266	0.03 %
Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LG				\$903,590,597	1.32 %
LG	BONDESG	250710	AAA(mex)	\$452,007,203	0.66 %
LG	BONDESG	260319	AAA(mex)	\$401,413,180	0.59 %
LG	BONDESG	270506	AAA(mex)	\$50,170,214	0.07 %
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Mensual)				\$2,514,263,991	3.67 %
IM	BPAG28	260507	AAA(mex)	\$723,738,197	1.06 %
IM	BPAG28	240808	AAA(mex)	\$497,647,458	0.73 %
IM	BPAG28	260806	AAA(mex)	\$400,995,320	0.59 %
IM	BPAG28	250508	AAA(mex)	\$376,014,020	0.55 %
IM	BPAG28	241107	AAA(mex)	\$175,513,720	0.26 %
IM	BPAG28	250206	AAA(mex)	\$150,089,036	0.22 %
IM	BPAG28	260205	AAA(mex)	\$99,898,467	0.15 %
IM	BPAG28	250807	AAA(mex)	\$90,367,773	0.13 %
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Semestral)				\$1,079,919,163	1.58 %
IS	BPA182	300328	AAA(mex)	\$333,740,963	0.49 %
IS	BPA182	290322	AAA(mex)	\$207,312,250	0.30 %
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	\$206,014,974	0.30 %
IS	BPA182	280412	AAA(mex)	\$201,995,862	0.29 %
IS	BPA182	301010	AAA(mex)	\$130,855,114	0.19 %
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)				\$1,686,144,283	2.46 %
IQ	BPAG91	280907	AAA(mex)	\$469,318,915	0.68 %
IQ	BPAG91	280511	AAA(mex)	\$400,361,008	0.58 %
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	\$305,066,337	0.45 %
IQ	BPAG91	280106	AAA(mex)	\$258,076,060	0.38 %
IQ	BPAG91	270107	AAA(mex)	\$253,321,963	0.37 %
Certificados de la Tesorería de la Federación				\$98,583,367	0.14 %
BI	CETES	250710	AAA(mex)	\$53,277,132	0.08 %
BI	CETES	250515	AAA(mex)	\$45,306,235	0.07 %
Total Deuda Gubernamental				\$30,619,069,876	44.69 %
TOTAL DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES				\$30,619,069,876	44.69 %
TOTAL DE INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS				\$30,619,069,876	44.69 %
OPERACIONES DE REPORTO					
REPORTADOR					
Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LD				\$500,500,566	0.73 %
LD	BONDESD	250814	AAA(mex)	\$500,500,566	0.73 %
Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LF				\$25,693,894,502	37.50 %
LF	BONDEF	250424	AAA(mex)	\$7,549,927,171	11.02 %
LF	BONDEF	250724	AAA(mex)	\$5,559,696,059	8.11 %
LF	BONDEF	270617	AAA(mex)	\$2,919,592,322	4.26 %
LF	BONDEF	250619	AAA(mex)	\$2,512,237,128	3.67 %
LF	BONDEF	261231	AAA(mex)	\$2,033,649,894	2.97 %
LF	BONDEF	241003	AAA(mex)	\$1,723,877,739	2.52 %
LF	BONDEF	250227	AAA(mex)	\$1,704,066,718	2.49 %
LF	BONDEF	270318	AAA(mex)	\$600,787,227	0.88 %
LF	BONDEF	270318	AAA(mex)	\$500,462,430	0.73 %
LF	BONDEF	270114	AAA(mex)	\$489,700,676	0.71 %
LF	BONDEF	250724	AAA(mex)	\$99,897,138	0.15 %
Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LG				\$700,646,248	1.02 %
LG	BONDESG	300314	AAA(mex)	\$700,646,248	1.02 %
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Mensual)				\$3,179,581,688	4.64 %
IM	BPAG28	240808	AAA(mex)	\$2,086,224,755	3.04 %

T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
IM	BPAG28	261105	AAA(mex)	\$459,561,658	0.67 %
IM	BPAG28	260507	AAA(mex)	\$401,754,112	0.59 %
IM	BPAG28	241107	AAA(mex)	\$232,041,163	0.34 %
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Semestral)				\$2,355,123,340	3.44 %
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	\$1,196,295,256	1.75 %
IS	BPA182	270930	AAA(mex)	\$920,157,602	1.34 %
IS	BPA182	300328	AAA(mex)	\$238,670,482	0.35 %
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)				\$5,470,899,418	7.98 %
IQ	BPAG91	280511	AAA(mex)	\$3,151,176,828	4.60 %
IQ	BPAG91	250430	AAA(mex)	\$1,069,548,239	1.56 %
IQ	BPAG91	290510	AAA(mex)	\$749,711,863	1.09 %
IQ	BPAG91	290111	AAA(mex)	\$500,462,488	0.73 %
TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE				\$37,900,645,762	55.31 %
TOTAL DE CARTERA:				\$68,519,715,638	100.00%
Límite Máximo de VaR: 0.010%				VaR Promedio: 0.0024%	
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.					
El Fondo no realizará estrategias temporales de Inversión.					

