

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

| NTEMP+ | | | | | |
|--|---------|--------|------------|-----------------------|-----------------|
| Fondo Banorte 8, 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 Gubernamental | | | | | |
| Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LD | | | | \$615,951,113 | 25.43 % |
| LD | BONDESD | 231221 | AAA(mex) | \$60,115,836 | 2.48 % |
| LD | BONDESD | 250619 | AAA(mex) | \$59,868,037 | 2.47 % |
| LD | BONDESD | 230831 | AAA(mex) | \$50,325,883 | 2.08 % |
| LD | BONDESD | 230629 | AAA(mex) | \$41,049,095 | 1.69 % |
| LD | BONDESD | 240425 | AAA(mex) | \$40,013,922 | 1.65 % |
| LD | BONDESD | 240627 | AAA(mex) | \$39,961,435 | 1.65 % |
| LD | BONDESD | 241219 | AAA(mex) | \$39,881,843 | 1.65 % |
| LD | BONDESD | 251016 | AAA(mex) | \$39,847,436 | 1.64 % |
| LD | BONDESD | 250416 | AAA(mex) | \$39,811,199 | 1.64 % |
| LD | BONDESD | 240229 | AAA(mex) | \$30,015,797 | 1.24 % |
| LD | BONDESD | 230504 | AAA(mex) | \$25,440,886 | 1.05 % |
| LD | BONDESD | 231207 | AAA(mex) | \$20,022,126 | 0.83 % |
| LD | BONDESD | 240404 | AAA(mex) | \$19,990,799 | 0.83 % |
| LD | BONDESD | 250814 | AAA(mex) | \$19,953,945 | 0.82 % |
| LD | BONDESD | 241024 | AAA(mex) | \$19,946,667 | 0.82 % |
| LD | BONDESD | 251211 | AAA(mex) | \$19,920,410 | 0.82 % |
| LD | BONDESD | 260212 | AAA(mex) | \$19,892,204 | 0.82 % |
| LD | BONDESD | 240530 | AAA(mex) | \$9,990,401 | 0.41 % |
| LD | BONDESD | 240801 | AAA(mex) | \$9,977,129 | 0.41 % |
| LD | BONDESD | 260806 | AAA(mex) | \$9,926,063 | 0.41 % |
| Bonos de Protección al Ahorro (Pago Mensual) | | | | \$160,022,378 | 6.61 % |
| IM | BPAG28 | 220811 | AAA(mex) | \$60,001,925 | 2.48 % |
| IM | BPAG28 | 220512 | AAA(mex) | \$30,041,064 | 1.24 % |
| IM | BPAG28 | 231109 | AAA(mex) | \$20,018,101 | 0.83 % |
| IM | BPAG28 | 230511 | AAA(mex) | \$19,997,528 | 0.83 % |
| IM | BPAG28 | 241107 | AAA(mex) | \$19,979,253 | 0.82 % |
| IM | BPAG28 | 230810 | AAA(mex) | \$9,984,507 | 0.41 % |
| Bonos de Protección al Ahorro (Pago Semestral) | | | | \$259,069,435 | 10.69 % |
| IS | BPA182 | 240307 | AAA(mex) | \$51,097,016 | 2.11 % |
| IS | BPA182 | 220908 | AAA(mex) | \$50,846,102 | 2.10 % |
| IS | BPA182 | 250306 | AAA(mex) | \$35,404,288 | 1.46 % |
| IS | BPA182 | 230907 | AAA(mex) | \$30,623,269 | 1.26 % |
| IS | BPA182 | 220310 | AAA(mex) | \$20,338,517 | 0.84 % |
| IS | BPA182 | 260219 | AAA(mex) | \$20,297,254 | 0.84 % |
| IS | BPA182 | 251002 | AAA(mex) | \$20,231,434 | 0.84 % |
| IS | BPA182 | 270401 | AAA(mex) | \$20,133,537 | 0.83 % |
| IS | BPA182 | 280412 | AAA(mex) | \$10,098,018 | 0.42 % |
| Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral) | | | | \$146,207,093 | 6.04 % |
| IQ | BPAG91 | 240111 | AAA(mex) | \$20,160,899 | 0.83 % |
| IQ | BPAG91 | 250102 | AAA(mex) | \$20,142,946 | 0.83 % |
| IQ | BPAG91 | 251231 | AAA(mex) | \$20,124,922 | 0.83 % |
| IQ | BPAG91 | 240502 | AAA(mex) | \$20,099,163 | 0.83 % |
| IQ | BPAG91 | 240829 | AAA(mex) | \$19,990,993 | 0.83 % |



| T. VALOR | EMISORA | SERIE | CALIF/BURS | VALOR RAZONABLE TOTAL | % PARTICIPACIÓN |
|---|---------|--------|------------|--------------------------|--------------------|
| IQ | BPAG91 | 250904 | AAA(mex) | \$19,950,047 | 0.82 % |
| IQ | BPAG91 | 221229 | AAA(mex) | \$17,992,564 | 0.74 % |
| IQ | BPAG91 | 220428 | AAA(mex) | \$7,745,559 | 0.32 % |
| Certificados de la Tesorería de la Federación | | | | \$360,917,244 | 14.90 % |
| BI | CETES | 221215 | AAA(mex) | \$93,739,330 | 3.87 % |
| BI | CETES | 220922 | AAA(mex) | \$56,249,444 | 2.32 % |
| BI | CETES | 221020 | AAA(mex) | \$55,935,528 | 2.31 % |
| BI | CETES | 220602 | AAA(mex) | \$39,013,032 | 1.61 % |
| BI | CETES | 220505 | AAA(mex) | \$34,302,324 | 1.42 % |
| BI | CETES | 220728 | AAA(mex) | \$33,757,780 | 1.39 % |
| BI | CETES | 221006 | AAA(mex) | \$28,521,450 | 1.18 % |
| BI | CETES | 220630 | AAA(mex) | \$19,398,356 | 0.80 % |
| Udibonos | | | | \$399,261,642 | 16.48 % |
| S | UDIBONO | 220609 | AAA(mex) | \$399,261,642 | 16.48 % |
| Total Deuda Gubernamental | | | | \$1,941,428,905 | 80.14 % |
| Deuda Bancaria | | | | | |
| Certificados Bursátiles Bancarios | | | | \$225,433,568 | 9.31 % |
| 94 | BSMX | 18 | AAA (mex) | \$55,150,475 | 2.28 % |
| 94 | BACOMER | 19 | AAA (mex) | \$50,037,235 | 2.07 % |
| 94 | SCOTIAB | 19-2 | AAA (mex) | \$40,054,608 | 1.65 % |
| 94 | HSBC | 19-2 | AAA (mex) | \$30,112,524 | 1.24 % |
| 94 | COMPART | 21S | AA (mex) | \$25,054,844 | 1.03 % |
| 94 | BSMX | 21 | AAA (mex) | \$25,023,882 | 1.03 % |
| Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo | | | | \$90,154,455 | 3.72 % |
| CD | NAFR | 240628 | mxAAA | \$30,068,555 | 1.24 % |
| CD | BACMEXT | 21X | AAA (mex) | \$30,046,853 | 1.24 % |
| CD | BACMEXT | 21 | mxAAA | \$30,039,047 | 1.24 % |
| Certificados de Depósito | | | | \$35,016,810 | 1.45 % |
| F | BSCTIA | 21002 | F1+ (mex) | \$35,016,810 | 1.45 % |
| Total Deuda Bancaria | | | | \$350,604,833 | 14.47 % |
| Otros Títulos de Deuda | | | | | |
| Certificados Bursátiles Corporativos | | | | \$39,066,808 | 1.61 % |
| 91 | SORIANA | 20 | AA+ (mex) | \$20,109,139 | 0.83 % |
| 91 | BBPEN | 21 | AAA (mex) | \$15,052,587 | 0.62 % |
| 91 | ALPHACB | 18 | mxBB | \$3,905,082 | 0.16 % |
| Total Otros Títulos de Deuda | | | | \$39,066,808 | 1.61 % |
| Instrumentos de Patrimonio Neto | | | | | |
| Obligaciones Comerciales, Industriales y Servicios | | | | \$0 | 0.00 % |
| 2 | LERMA | 90 | | \$0 | 0.00 % |
| Total Instrumentos de Patrimonio Neto | | | | \$0 | 0.00 % |
| TOTAL DE TÍTULOS PARA NEGOCIAR | | | | \$2,331,100,546 | 96.22 % |
| TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES | | | | \$2,331,100,546 | 96.22 % |
| OPERACIONES DE REPORTE | | | | | |
| REPORTADOR | | | | | |
| Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral) | | | | \$91,509,389 | 3.78 % |
| IQ | BPAG91 | 260507 | AAA(mex) | \$64,056,592 | 2.64 % |
| IQ | BPAG91 | 260507 | AAA(mex) | \$27,452,797 | 1.13 % |
| TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE | | | | \$91,509,389 | 3.78 % |

| T. VALOR | EMISORA | SERIE | CALIF/BURS | VALOR RAZONABLE TOTAL | % PARTICIPACIÓN |
|--|---------|-------|-----------------------|------------------------|-----------------|
| TOTAL DE CARTERA: | | | | \$2,422,609,935 | 100.00% |
| Límite Máximo de VaR: 0.270% | | | VaR Promedio: 0.0237% | | |
| 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. | | | | | |
| Actualmente el Fondo no se encuentra en estrategia temporal de inversión. | | | | | |
| TV | EMISORA | SERIE | CALIF/BURS | VALOR RAZONABLE TOTAL | % PARTICIPACIÓN |
| Valores Respalados por Activos. | | | | | |
| 91 | ALPHACB | 18 | mxBB | \$3,905,082 | 0.16 % |
| Total: | | | | \$3,905,082 | 0.16% |
| "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" | | | | | |

