

Composición de la Cartera de Inversión al 18 de abril de 2024.

APIBONO					
Fondo Banorte 33, S.A. de C.V. Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda					
Categoría: Largo Plazo Gubernamental					
Calificación: AAAf/S5(mex)					
T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS					
INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES					
Deuda Gubernamental					
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Mensual)				\$5,011,837	0.65 %
IM	BPAG28	240509	AAA(mex)	\$5,011,837	0.65 %
Bonos del Gobierno Federal (Tasa Fija)				\$628,449,473	81.48 %
M	BONOS	260305	AAA(mex)	\$61,328,566	7.95 %
M	BONOS	330526	AAA(mex)	\$60,415,608	7.83 %
M	BONOS	270603	AAA(mex)	\$60,241,512	7.81 %
M	BONOS	310529	AAA(mex)	\$57,458,824	7.45 %
M	BONOS	270304	AAA(mex)	\$48,572,163	6.30 %
M	BONOS	421113	AAA(mex)	\$42,871,154	5.56 %
M	BONOS	290531	AAA(mex)	\$40,444,865	5.24 %
M	BONOS	240905	AAA(mex)	\$40,190,983	5.21 %
M	BONOS	471107	AAA(mex)	\$33,785,039	4.38 %
M	BONOS	381118	AAA(mex)	\$29,935,148	3.88 %
M	BONOS	530731	AAA(mex)	\$29,124,239	3.78 %
M	BONOS	241205	AAA(mex)	\$26,781,205	3.47 %
M	BONOS	260903	AAA(mex)	\$23,385,052	3.03 %
M	BONOS	290301	AAA(mex)	\$22,343,719	2.90 %
M	BONOS	341123	AAA(mex)	\$21,338,739	2.77 %
M	BONOS	250306	AAA(mex)	\$19,611,726	2.54 %
M	BONOS	361120	AAA(mex)	\$10,620,931	1.38 %
Certificados de la Tesorería de la Federación				\$116,730,822	15.13 %
BI	CETES	240502	AAA(mex)	\$14,940,552	1.94 %
BI	CETES	240627	AAA(mex)	\$9,790,947	1.27 %
BI	CETES	240822	AAA(mex)	\$9,625,369	1.25 %
BI	CETES	241211	AAA(mex)	\$9,312,586	1.21 %
BI	CETES	250306	AAA(mex)	\$9,084,648	1.18 %
BI	CETES	240530	AAA(mex)	\$4,937,914	0.64 %
BI	CETES	240725	AAA(mex)	\$4,853,886	0.63 %
BI	CETES	241003	AAA(mex)	\$4,752,447	0.62 %
BI	CETES	241017	AAA(mex)	\$4,732,564	0.61 %
BI	CETES	241114	AAA(mex)	\$4,693,473	0.61 %
BI	CETES	250109	AAA(mex)	\$4,616,996	0.60 %
BI	CETES	250123	AAA(mex)	\$4,598,063	0.60 %
BI	CETES	250206	AAA(mex)	\$4,579,242	0.59 %
BI	CETES	250320	AAA(mex)	\$4,535,174	0.59 %
BI	CETES	250403	AAA(mex)	\$4,506,121	0.58 %
BI	CETES	250515	AAA(mex)	\$4,484,546	0.58 %
BI	CETES	250710	AAA(mex)	\$4,380,720	0.57 %
BI	CETES	251224	AAA(mex)	\$4,183,718	0.54 %
BI	CETES	260219	AAA(mex)	\$4,121,856	0.53 %
Total Deuda Gubernamental				\$750,192,132	97.26 %
TOTAL DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES				\$750,192,132	97.26 %
TOTAL DE INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS				\$750,192,132	97.26 %



T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADOR					
	Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal	LF		\$21,126,932	2.74 %
LF	BONDESF	250724	AAA(mex)	\$21,126,932	2.74 %
TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE				\$21,126,932	2.74 %
TOTAL DE CARTERA:				\$771,319,064	100.00%
Límite Máximo de VaR: 2.500%			VaR Promedio: 0.2498%		
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.					
Actualmente el Fondo no se encuentra en estrategia temporal de inversión.					



Signatory of:

