

Composición de la Cartera de Inversión al 20 de junio 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 del Gobierno Federal (Tasa Fija)				\$634,339,952	81.95 %
M	BONOS	260305	AAA(mex)	\$62,209,814	8.04 %
M	BONOS	330526	AAA(mex)	\$61,230,431	7.91 %
M	BONOS	270603	AAA(mex)	\$58,612,308	7.57 %
M	BONOS	310529	AAA(mex)	\$55,718,887	7.20 %
M	BONOS	270304	AAA(mex)	\$49,238,828	6.36 %
M	BONOS	421113	AAA(mex)	\$41,343,514	5.34 %
M	BONOS	240905	AAA(mex)	\$40,969,192	5.29 %
M	BONOS	290531	AAA(mex)	\$39,113,787	5.05 %
M	BONOS	260903	AAA(mex)	\$33,174,617	4.29 %
M	BONOS	471107	AAA(mex)	\$32,449,895	4.19 %
M	BONOS	530731	AAA(mex)	\$31,888,583	4.12 %
M	BONOS	381118	AAA(mex)	\$28,861,873	3.73 %
M	BONOS	241205	AAA(mex)	\$25,962,632	3.35 %
M	BONOS	290301	AAA(mex)	\$22,571,233	2.92 %
M	BONOS	341123	AAA(mex)	\$20,714,239	2.68 %
M	BONOS	250306	AAA(mex)	\$20,031,354	2.59 %
M	BONOS	361120	AAA(mex)	\$10,248,765	1.32 %
Certificados de la Tesorería de la Federación				\$119,989,012	15.50 %
BI	CETES	240627	AAA(mex)	\$9,981,727	1.29 %
BI	CETES	240822	AAA(mex)	\$9,811,791	1.27 %
BI	CETES	241211	AAA(mex)	\$9,487,983	1.23 %
BI	CETES	250306	AAA(mex)	\$9,252,070	1.20 %
BI	CETES	250430	AAA(mex)	\$9,108,206	1.18 %
BI	CETES	250529	AAA(mex)	\$9,030,155	1.17 %
BI	CETES	241003	AAA(mex)	\$4,843,971	0.63 %
BI	CETES	241017	AAA(mex)	\$4,823,707	0.62 %
BI	CETES	241114	AAA(mex)	\$4,782,590	0.62 %
BI	CETES	250109	AAA(mex)	\$4,703,613	0.61 %
BI	CETES	250123	AAA(mex)	\$4,683,589	0.61 %
BI	CETES	250206	AAA(mex)	\$4,664,719	0.60 %
BI	CETES	250320	AAA(mex)	\$4,613,663	0.60 %
BI	CETES	250403	AAA(mex)	\$4,588,552	0.59 %
BI	CETES	250515	AAA(mex)	\$4,544,817	0.59 %
BI	CETES	250710	AAA(mex)	\$4,461,736	0.58 %
BI	CETES	251224	AAA(mex)	\$4,246,717	0.55 %
BI	CETES	260219	AAA(mex)	\$4,180,923	0.54 %
BI	CETES	260416	AAA(mex)	\$4,119,382	0.53 %
BI	CETES	260611	AAA(mex)	\$4,059,101	0.52 %
Total Deuda Gubernamental				\$754,328,964	97.45 %
TOTAL DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES				\$754,328,964	97.45 %
TOTAL DE INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS				\$754,328,964	97.45 %
OPERACIONES DE REPORTEO					


Swiss Certified
ISO 9001:2015

Signatory of:



T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
REPORTADOR					
	Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal	LF		\$19,757,429	2.55 %
LF	BONDEF	271014	AAA(mex)	\$19,757,429	2.55 %
TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE				\$19,757,429	2.55 %
TOTAL DE CARTERA:				\$774,086,393	100.00%
Límite Máximo de VaR: 2.500%			VaR Promedio: 0.2297%		
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.					

