

Composición de la Cartera de Inversión al 30 de junio de 2022.

NTEDP					
Fondo Banorte 10, 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 Bancaria					
Certificados Bursátiles Bancarios				\$1,316,446,185	15.85 %
94	BLADEX	19	AAA (mex)	\$227,898,802	2.74 %
94	BINBUR	18	mxAAA	\$121,087,470	1.46 %
94	BACTIN	19-2	HR AA-	\$120,158,618	1.45 %
94	SCOTIAB	19-2	AAA (mex)	\$110,362,584	1.33 %
94	SCOTIAB	19	AAA (mex)	\$110,269,353	1.33 %
94	BACOMER	20-2	AAA (mex)	\$105,270,660	1.27 %
94	BBVAMX	22X	AAA (mex)	\$85,173,824	1.03 %
94	BSMX	22	AAA (mex)	\$80,048,055	0.96 %
94	COMPART	21S	AA (mex)	\$75,374,678	0.91 %
94	BSMX	21	AAA (mex)	\$75,275,500	0.91 %
94	BLADEX	20	AAA (mex)	\$55,283,840	0.67 %
94	BACOMER	20	AAA (mex)	\$55,044,054	0.66 %
94	BANORTE	19-2	mxAAA	\$50,261,374	0.61 %
94	COMPART	19	AA (mex)	\$44,937,373	0.54 %
Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo				\$732,476,739	8.82 %
CD	BANOB	20-2X	AAA (mex)	\$100,682,044	1.21 %
CD	SHF	21	AAA (mex)	\$100,119,851	1.21 %
CD	BACMEXT	21X	AAA (mex)	\$80,290,284	0.97 %
CD	SHF	21-3	AAA (mex)	\$80,183,680	0.97 %
CD	BANOB	21-4X	AAA (mex)	\$80,150,674	0.97 %
CD	BACMEXT	22X	AAA (mex)	\$80,094,302	0.96 %
CD	BANOB	22	AAA (mex)	\$80,010,564	0.96 %
CD	NAFR	21X	mxAAA	\$75,369,668	0.91 %
CD	NAFR	17S	AAA (mex)	\$55,575,672	0.67 %
Certificados de Depósito				\$170,798,177	2.06 %
F	BACTINV	22012	HR1	\$85,416,802	1.03 %
F	BANSAN	22020	F1+ (mex)	\$85,381,375	1.03 %
Pagaré con Rendimiento Liquidable al Vencimiento				\$500,108,609	6.02 %
I	BANOBRA	22265	mxAAA	\$500,108,609	6.02 %
Títulos de Organismos Financieros Multilaterales				\$364,706,184	4.39 %
JI	BIDINV	1-20	mxAAA	\$100,642,818	1.21 %
JI	CABEI	1-21S	mxAAA	\$95,059,530	1.14 %
JI	BIDINV	1-21G	mxAAA	\$85,239,032	1.03 %
JI	CABEI	2-19	mxAAA	\$55,104,834	0.66 %
JI	CABEI	1-20	mxAAA	\$28,659,970	0.35 %
Total Deuda Bancaria				\$3,084,535,894	37.14 %
Otros Títulos de Deuda					
Certificados Bursátiles Emitidos por Entidades o Instituciones del Gobierno Federal				\$431,639,227	5.20 %
95	FEFA	19V	mxAAA	\$100,597,418	1.21 %
95	FNCOT	19	AAA (mex)	\$100,113,777	1.21 %
95	FNCOT	21G	AAA (mex)	\$80,329,438	0.97 %
95	FNCOT	21-2G	AAA (mex)	\$75,376,232	0.91 %



T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
95	FEFA	20G	mxAAA	\$50,089,387	0.60 %
95	FEFA	19-3	mxAAA	\$25,132,975	0.30 %
Certificados Bursátiles Corporativos				\$2,730,586,639	32.88 %
91	SORIANA	20	AA+ (mex)	\$150,577,543	1.81 %
91	BACHOCO	17	AAA (mex)	\$130,348,917	1.57 %
91	LIVEPOL	17-2	AAA (mex)	\$130,145,119	1.57 %
91	NRF	19	Aa3.mx	\$121,093,762	1.46 %
91	GAP	20	mxAAA	\$119,998,608	1.45 %
91	GRUMA	18	mxAA+	\$106,218,014	1.28 %
91	GMXT	17-2	AAA (mex)	\$101,469,494	1.22 %
91	GCARSO	20	AAA (mex)	\$100,560,023	1.21 %
91	NM	21	mxAA+	\$100,231,064	1.21 %
91	GMXT	19-2	AAA (mex)	\$99,395,395	1.20 %
91	GPH	19	AAA (mex)	\$90,786,643	1.09 %
91	TIPMXCB	20-2	AAA (mex)	\$85,583,400	1.03 %
91	AC	22-2	AAA (mex)	\$85,273,394	1.03 %
91	HERDEZ	22-2L	AA (mex)	\$85,038,583	1.02 %
91	CETEMEM	22-2	B+ (mex)	\$85,019,189	1.02 %
91	ACBE	17-2	AAA (mex)	\$83,019,162	1.00 %
91	GAP	19	mxAAA	\$80,601,866	0.97 %
91	CETEMEM	21-3	AAA (mex)	\$80,510,584	0.97 %
91	ACBE	21V	AAA (mex)	\$80,382,070	0.97 %
91	GAP	22	mxAAA	\$80,352,519	0.97 %
91	FERROMX	21-2	AAA (mex)	\$80,242,766	0.97 %
91	OMA	22L	AAA (mex)	\$80,103,349	0.96 %
91	KOF	21-2L	Aaa.mx	\$80,017,785	0.96 %
91	VWLEASE	22	mxAAA	\$75,150,167	0.90 %
91	VWLEASE	19-2	mxAAA	\$74,086,228	0.89 %
91	MOLYMET	21	AAA (mex)	\$70,092,065	0.84 %
91	BBPEN	21	AAA (mex)	\$60,064,376	0.72 %
91	GAP	21V	mxAAA	\$50,109,635	0.60 %
91	ARRENCB	21	mxAAA	\$46,209,798	0.56 %
91	GAP	17-2	mxAAA	\$40,159,011	0.48 %
91	KOF	20-2	AAA (mex)	\$26,615,659	0.32 %
91	ACTINVR	19-2	AA- (mex)	\$24,034,851	0.29 %
91	CRELCB	19	HR AA+	\$11,644,402	0.14 %
91	ACTINVR	19	AA- (mex)	\$10,047,155	0.12 %
91	FUTILCB	19	mxAAA	\$4,004,356	0.05 %
91	CREALCB	17	HR AA+	\$1,399,687	0.02 %
Certificados Bursátiles Corporativos (Corto Plazo)				\$30,020,253	0.36 %
93	TOYOTA	03222	F1+ (mex)	\$30,020,253	0.36 %
Total Otros Títulos de Deuda				\$3,192,246,119	38.44 %
TOTAL DE TÍTULOS PARA NEGOCIAR				\$6,276,782,013	75.59 %
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES				\$6,276,782,013	75.59 %
OPERACIONES DE REPORTO REPORTADOR					
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Mensual)				\$527,408,170	6.35 %
IM	BPAG28	241107	AAA(mex)	\$527,408,170	6.35 %
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)				\$999,871,306	12.04 %
IQ	BPAG91	230831	AAA(mex)	\$696,558,563	8.39 %
IQ	BPAG91	250430	AAA(mex)	\$303,312,743	3.65 %
Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo				\$500,109,409	6.02 %
CD	BANOB	21-2X	AAA (mex)	\$250,054,753	3.01 %
CD	SHF	21-2	AAA (mex)	\$250,054,656	3.01 %



T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE				\$2,027,388,885	24.41 %
TOTAL DE CARTERA:				\$8,304,170,898	100.00%
Límite Máximo de VaR: 0.350%			VaR Promedio: 0.0150%		
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 Respaldados por Activos.					
91	CREALCB	17	HR AA+	\$1,399,687	0.02 %
91	ARRENCB	21	mxAAA	\$46,209,798	0.56 %
91	FUTILCB	19	mxAAA	\$4,004,356	0.05 %
91	CRELCB	19	HR AA+	\$11,644,402	0.14 %
91	TIPMXCB	20-2	AAA (mex)	\$85,583,400	1.03 %
			Total:	\$148,841,643	1.79%
"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"					

