

Composición de la Cartera de Inversión al 23 de septiembre de 2021.

NTEGUB+					
Fondo Banorte 1, S.A. de C.V. Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda					
Categoría: Corto Plazo Gubernamental					
Calificación: AAAf/S2(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				\$2,158,355,384	24.66 %
LD	BONDESD	250619	AAA(mex)	\$129,283,876	1.48 %
LD	BONDESD	220127	AAA(mex)	\$90,146,856	1.03 %
LD	BONDESD	250416	AAA(mex)	\$89,620,154	1.02 %
LD	BONDESD	251016	AAA(mex)	\$89,357,725	1.02 %
LD	BONDESD	231221	AAA(mex)	\$80,178,577	0.92 %
LD	BONDESD	220512	AAA(mex)	\$80,177,730	0.92 %
LD	BONDESD	230629	AAA(mex)	\$79,827,002	0.91 %
LD	BONDESD	250814	AAA(mex)	\$79,545,164	0.91 %
LD	BONDESD	221110	AAA(mex)	\$76,995,266	0.88 %
LD	BONDESD	220721	AAA(mex)	\$73,026,945	0.83 %
LD	BONDESD	220428	AAA(mex)	\$70,042,061	0.80 %
LD	BONDESD	211118	AAA(mex)	\$70,001,472	0.80 %
LD	BONDESD	230105	AAA(mex)	\$69,976,521	0.80 %
LD	BONDESD	240229	AAA(mex)	\$69,817,305	0.80 %
LD	BONDESD	240404	AAA(mex)	\$69,738,169	0.80 %
LD	BONDESD	241024	AAA(mex)	\$59,863,088	0.68 %
LD	BONDESD	241219	AAA(mex)	\$59,839,943	0.68 %
LD	BONDESD	240822	AAA(mex)	\$50,762,412	0.58 %
LD	BONDESD	220203	AAA(mex)	\$50,041,363	0.57 %
LD	BONDESD	220113	AAA(mex)	\$49,994,507	0.57 %
LD	BONDESD	240425	AAA(mex)	\$49,854,661	0.57 %
LD	BONDESD	250220	AAA(mex)	\$49,800,132	0.57 %
LD	BONDESD	220908	AAA(mex)	\$45,729,275	0.52 %
LD	BONDESD	230309	AAA(mex)	\$40,224,547	0.46 %
LD	BONDESD	220317	AAA(mex)	\$40,094,732	0.46 %
LD	BONDESD	220714	AAA(mex)	\$40,045,644	0.46 %
LD	BONDESD	230706	AAA(mex)	\$40,019,532	0.46 %
LD	BONDESD	230831	AAA(mex)	\$40,007,396	0.46 %
LD	BONDESD	230504	AAA(mex)	\$39,924,002	0.46 %
LD	BONDESD	231207	AAA(mex)	\$39,917,154	0.46 %
LD	BONDESD	240627	AAA(mex)	\$39,827,270	0.46 %
LD	BONDESD	260212	AAA(mex)	\$39,796,956	0.45 %
LD	BONDESD	251211	AAA(mex)	\$39,703,886	0.45 %
LD	BONDESD	230330	AAA(mex)	\$30,124,572	0.34 %
LD	BONDESD	211007	AAA(mex)	\$30,057,099	0.34 %
LD	BONDESD	231101	AAA(mex)	\$29,970,866	0.34 %
LD	BONDESD	221013	AAA(mex)	\$20,000,695	0.23 %
LD	BONDESD	220421	AAA(mex)	\$15,020,829	0.17 %
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Mensual)				\$289,983,855	3.31 %
IM	BPAG28	220210	AAA(mex)	\$69,988,122	0.80 %
IM	BPAG28	220512	AAA(mex)	\$40,086,946	0.46 %
IM	BPAG28	230511	AAA(mex)	\$40,019,863	0.46 %
IM	BPAG28	231109	AAA(mex)	\$39,908,924	0.46 %
IM	BPAG28	211111	AAA(mex)	\$30,032,062	0.34 %



T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
IM	BPAG28	230209	AAA(mex)	\$29,949,754	0.34 %
IM	BPAG28	220811	AAA(mex)	\$20,018,019	0.23 %
IM	BPAG28	230810	AAA(mex)	\$19,980,165	0.23 %
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Semestral)				\$372,795,390	4.26 %
IS	BPA182	220908	AAA(mex)	\$80,375,522	0.92 %
IS	BPA182	240307	AAA(mex)	\$50,383,447	0.58 %
IS	BPA182	270401	AAA(mex)	\$40,714,594	0.47 %
IS	BPA182	230907	AAA(mex)	\$40,261,966	0.46 %
IS	BPA182	250306	AAA(mex)	\$39,950,478	0.46 %
IS	BPA182	251002	AAA(mex)	\$30,574,321	0.35 %
IS	BPA182	220310	AAA(mex)	\$30,248,065	0.35 %
IS	BPA182	280412	AAA(mex)	\$30,234,145	0.35 %
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	\$30,052,852	0.34 %
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)				\$432,936,580	4.95 %
IQ	BPAG91	221229	AAA(mex)	\$52,434,604	0.60 %
IQ	BPAG91	240111	AAA(mex)	\$50,240,870	0.57 %
IQ	BPAG91	230427	AAA(mex)	\$40,200,859	0.46 %
IQ	BPAG91	240502	AAA(mex)	\$40,082,719	0.46 %
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	\$40,058,512	0.46 %
IQ	BPAG91	211223	AAA(mex)	\$39,995,535	0.46 %
IQ	BPAG91	230831	AAA(mex)	\$39,971,962	0.46 %
IQ	BPAG91	240829	AAA(mex)	\$39,889,867	0.46 %
IQ	BPAG91	250904	AAA(mex)	\$39,781,692	0.45 %
IQ	BPAG91	220428	AAA(mex)	\$30,208,421	0.35 %
IQ	BPAG91	250102	AAA(mex)	\$20,071,539	0.23 %
Total Deuda Gubernamental				\$3,254,071,209	37.18 %
TOTAL DE TÍTULOS PARA NEGOCIAR				\$3,254,071,209	37.18 %
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES				\$3,254,071,209	37.18 %
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADOR					
Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal				\$4,409,537,188	50.38 %
LD	BONDESD	250220	AAA(mex)	\$1,944,698,981	22.22 %
LD	BONDESD	220317	AAA(mex)	\$964,647,426	11.02 %
LD	BONDESD	250416	AAA(mex)	\$816,370,076	9.33 %
LD	BONDESD	231005	AAA(mex)	\$683,820,705	7.81 %
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Mensual)				\$640,033,927	7.31 %
IM	BPAG28	230511	AAA(mex)	\$640,033,927	7.31 %
Certificados de la Tesorería de la Federación				\$448,570,860	5.13 %
BI	CETES	220331	AAA(mex)	\$448,570,860	5.13 %
TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE				\$5,498,141,975	62.82 %
TOTAL DE CARTERA:				\$8,752,213,184	100.00%
Límite Máximo de VaR: 0.005%				VaR Promedio: 0.0030%	
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.					

