

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

NTEGUB					
Fondo Banorte 3, S.A de C.V. Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda					
Categoría: Corto Plazo Gubernamental					
Calificación: AAAf/S1(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				\$3,694,015,886	6.73 %
LD	BONDESD	230330	AAA(mex)	\$836,019,510	1.52 %
LD	BONDESD	230629	AAA(mex)	\$579,735,735	1.06 %
LD	BONDESD	230105	AAA(mex)	\$440,617,333	0.80 %
LD	BONDESD	240201	AAA(mex)	\$404,844,857	0.74 %
LD	BONDESD	230706	AAA(mex)	\$270,139,918	0.49 %
LD	BONDESD	230309	AAA(mex)	\$229,953,259	0.42 %
LD	BONDESD	240530	AAA(mex)	\$171,548,049	0.31 %
LD	BONDESD	220908	AAA(mex)	\$170,502,340	0.31 %
LD	BONDESD	240229	AAA(mex)	\$169,897,390	0.31 %
LD	BONDESD	240404	AAA(mex)	\$169,602,110	0.31 %
LD	BONDESD	240627	AAA(mex)	\$139,613,503	0.25 %
LD	BONDESD	220721	AAA(mex)	\$61,557,798	0.11 %
LD	BONDESD	230504	AAA(mex)	\$49,984,084	0.09 %
Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LF				\$8,639,180,436	15.74 %
LF	BONDESF	230202	AAA(mex)	\$2,503,362,672	4.56 %
LF	BONDESF	230330	AAA(mex)	\$1,321,648,601	2.41 %
LF	BONDESF	230302	AAA(mex)	\$1,233,594,122	2.25 %
LF	BONDESF	231005	AAA(mex)	\$751,334,768	1.37 %
LF	BONDESF	221006	AAA(mex)	\$702,054,829	1.28 %
LF	BONDESF	221201	AAA(mex)	\$701,977,934	1.28 %
LF	BONDESF	231130	AAA(mex)	\$701,037,946	1.28 %
LF	BONDESF	230622	AAA(mex)	\$420,476,570	0.77 %
LF	BONDESF	221103	AAA(mex)	\$180,517,237	0.33 %
LF	BONDESF	250227	AAA(mex)	\$123,175,757	0.22 %
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Mensual)				\$6,628,421,174	12.08 %
IM	BPAG28	231109	AAA(mex)	\$979,740,222	1.79 %
IM	BPAG28	230810	AAA(mex)	\$826,213,616	1.51 %
IM	BPAG28	240509	AAA(mex)	\$826,182,324	1.51 %
IM	BPAG28	230511	AAA(mex)	\$822,866,261	1.50 %
IM	BPAG28	230209	AAA(mex)	\$814,720,145	1.48 %
IM	BPAG28	240208	AAA(mex)	\$800,455,236	1.46 %
IM	BPAG28	220811	AAA(mex)	\$788,660,614	1.44 %
IM	BPAG28	240808	AAA(mex)	\$344,735,102	0.63 %
IM	BPAG28	221110	AAA(mex)	\$250,294,733	0.46 %
IM	BPAG28	241107	AAA(mex)	\$174,552,921	0.32 %
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)				\$754,309,189	1.37 %
IQ	BPAG91	230427	AAA(mex)	\$252,792,633	0.46 %
IQ	BPAG91	220825	AAA(mex)	\$251,593,943	0.46 %
IQ	BPAG91	221229	AAA(mex)	\$249,922,613	0.46 %
Total Deuda Gubernamental				\$19,715,926,685	35.93 %
TOTAL DE TÍTULOS PARA NEGOCIAR				\$19,715,926,685	35.93 %
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES				\$19,715,926,685	35.93 %
OPERACIONES DE REPORTO					



T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
REPORTADOR					
Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LD				\$4,303,426,928	7.84 %
LD	BONDESD	250220	AAA(mex)	\$1,743,753,155	3.18 %
LD	BONDESD	230504	AAA(mex)	\$824,875,247	1.50 %
LD	BONDESD	240801	AAA(mex)	\$500,108,727	0.91 %
LD	BONDESD	251016	AAA(mex)	\$300,065,411	0.55 %
LD	BONDESD	230706	AAA(mex)	\$277,760,306	0.51 %
LD	BONDESD	240404	AAA(mex)	\$250,287,489	0.46 %
LD	BONDESD	260806	AAA(mex)	\$206,273,095	0.38 %
LD	BONDESD	231005	AAA(mex)	\$200,303,498	0.36 %
Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LF				\$14,934,682,948	27.21 %
LF	BONDESF	240201	AAA(mex)	\$6,338,763,065	11.55 %
LF	BONDESF	270318	AAA(mex)	\$4,913,957,707	8.95 %
LF	BONDESF	250227	AAA(mex)	\$1,296,071,950	2.36 %
LF	BONDESF	250424	AAA(mex)	\$996,756,896	1.82 %
LF	BONDESF	240104	AAA(mex)	\$499,691,023	0.91 %
LF	BONDESF	230330	AAA(mex)	\$300,346,254	0.55 %
LF	BONDESF	231005	AAA(mex)	\$250,194,816	0.46 %
LF	BONDESF	261001	AAA(mex)	\$203,982,232	0.37 %
LF	BONDESF	240201	AAA(mex)	\$134,919,005	0.25 %
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Mensual)				\$5,633,759,622	10.27 %
IM	BPAG28	221110	AAA(mex)	\$1,913,494,252	3.49 %
IM	BPAG28	241107	AAA(mex)	\$1,519,787,237	2.77 %
IM	BPAG28	230810	AAA(mex)	\$500,108,700	0.91 %
IM	BPAG28	240808	AAA(mex)	\$500,108,651	0.91 %
IM	BPAG28	240808	AAA(mex)	\$500,108,651	0.91 %
IM	BPAG28	240808	AAA(mex)	\$500,108,651	0.91 %
IM	BPAG28	240808	AAA(mex)	\$200,043,480	0.36 %
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Semestral)				\$2,808,377,976	5.12 %
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	\$1,304,591,207	2.38 %
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	\$1,177,393,670	2.15 %
IS	BPA182	250306	AAA(mex)	\$326,393,099	0.59 %
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)				\$7,484,287,081	13.64 %
IQ	BPAG91	250430	AAA(mex)	\$2,120,102,686	3.86 %
IQ	BPAG91	240829	AAA(mex)	\$1,942,676,844	3.54 %
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	\$1,551,184,103	2.83 %
IQ	BPAG91	250102	AAA(mex)	\$1,216,011,509	2.22 %
IQ	BPAG91	260507	AAA(mex)	\$250,991,755	0.46 %
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	\$201,985,017	0.37 %
IQ	BPAG91	250430	AAA(mex)	\$201,335,167	0.37 %
TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTO				\$35,164,534,555	64.07 %
TOTAL DE CARTERA:				\$54,880,461,240	100.00%

Límite Máximo de VaR: 0.010%

VaR Promedio: 0.0020%

Valor en Riesgo (VaR) Supuestos y Metodología: Horizonte de tiempo de un día y con nivel de confianza al 95% a dos cosas basada en una simulación histórica no paramétrica de 500 observaciones.

El Fondo no realizará estrategias temporales de Inversión.

