

Composición de la Cartera de Inversión al 31 de mayo de 2024.

NTE2					
Fondo Banorte 16, S.A. de C.V. Fondo de Inversión de Renta Variable					
Categoría: Discrecional					
T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
EFFECTIVO Y EQUIVALENTES DE EFFECTIVO					
Chequera en Pesos				\$58,470	0.02 %
CHM	040072	7144822	N/A	\$58,470	0.02 %
TOTAL DE EFFECTIVO Y EQUIVALENTES DE EFFECTIVO				\$58,470	0.02 %
INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS					
INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES					
Otros Títulos de Deuda					
Acciones de Fondos de Inversión de Deuda				\$97,799,296	32.18 %
51	NTED	FF	AAAf/S4 (mex)	\$40,311,638	13.27 %
51	NTEMPG	FF	AAAf/S4 (mex)	\$29,693,439	9.77 %
51	NTELP	FF	AAAf/S5 (mex)	\$27,794,219	9.15 %
Total Otros Títulos de Deuda				\$97,799,296	32.18 %
Instrumentos financieros de capital					
Acciones de Fondos de Inversión de Renta Variable				\$118,745,102	39.08 %
52	NTESEL	FF	N/A	\$29,155,369	9.59 %
52	NTEIPC+	FF	N/A	\$23,774,117	7.82 %
52	NTEUSA	FF	N/A	\$11,637,619	3.83 %
52	NTEINT+	FF	N/A	\$11,483,562	3.78 %
52	NTEMXN	FF	N/A	\$9,490,331	3.12 %
52	NTEUSA+	FF	N/A	\$9,395,312	3.09 %
52	NTERT	FF	N/A	\$7,162,937	2.36 %
52	NTEDLS+	FF	N/A	\$5,949,927	1.96 %
52	NTEESG	FF	N/A	\$5,681,690	1.87 %
52	NTEAI	FF	N/A	\$5,014,238	1.65 %
Títulos Referenciados a Acciones, TRACS Extranjeros				\$87,272,865	28.72 %
1ISP	FLOA	N	Alta	\$23,053,903	7.59 %
1ISP	LQDA	N	Alta	\$14,508,383	4.77 %
1ISP	AGG	*	Alta	\$14,071,726	4.63 %
1ISP	VEU	*	Alta	\$12,813,125	4.22 %
1ISP	SUAS	N	Alta	\$9,121,545	3.00 %
1ISP	MBB	*	Alta	\$3,525,582	1.16 %
1ISP	XSOE	*	Alta	\$3,159,364	1.04 %
1ISP	DGRO	*	Alta	\$2,608,143	0.86 %
1ISP	SPSB	*	Alta	\$1,368,786	0.45 %
1ISP	SPIB	*	Alta	\$1,035,017	0.34 %
1ISP	SPLB	*	Alta	\$1,020,621	0.34 %
1ISP	LQD	*	Alta	\$986,670	0.32 %
Total instrumentos financieros de capital				\$206,017,967	67.80 %
TOTAL DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES				\$303,817,263	99.98 %
TOTAL DE INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS				\$303,817,263	99.98 %

T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
TOTAL DE CARTERA:				\$303,875,733	100.00%
Límite Máximo de VaR: 1.100%			VaR Promedio: 0.5349%		
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.					
51	NTED	https://www.banorte.com/cms/casadebolsabanorteixe/fondosdeinversion/informacionparticular/semanales/NTED_SEMANAL.pdf?1689080040725			

