

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

NTECT					
Fondo Banorte 4, S.A. de C.V. Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda					
Categoría: Corto Plazo					
Calificación: AAAf/S1(mex)					
T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
DISPONIBILIDADES					
Chequera en Pesos				\$3,875,353,488	4.24 %
CHM	040072	6927986	N/A	\$3,875,353,488	4.24 %
TOTAL DE DISPONIBILIDADES				\$3,875,353,488	4.24 %
INVERSIONES EN VALORES					
TÍTULOS PARA NEGOCIAR					
Deuda Gubernamental					
Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LD				\$4,649,258,269	5.09 %
LD	BONDESD	230330	AAA(mex)	\$886,080,558	0.97 %
LD	BONDESD	230629	AAA(mex)	\$699,681,059	0.77 %
LD	BONDESD	230105	AAA(mex)	\$585,482,799	0.64 %
LD	BONDESD	240201	AAA(mex)	\$464,821,872	0.51 %
LD	BONDESD	230706	AAA(mex)	\$301,111,326	0.33 %
LD	BONDESD	240404	AAA(mex)	\$289,321,246	0.32 %
LD	BONDESD	240530	AAA(mex)	\$277,269,522	0.30 %
LD	BONDESD	240229	AAA(mex)	\$261,823,670	0.29 %
LD	BONDESD	220908	AAA(mex)	\$230,679,636	0.25 %
LD	BONDESD	230309	AAA(mex)	\$219,955,292	0.24 %
LD	BONDESD	240627	AAA(mex)	\$216,595,591	0.24 %
LD	BONDESD	221110	AAA(mex)	\$75,905,998	0.08 %
LD	BONDESD	230504	AAA(mex)	\$61,993,359	0.07 %
LD	BONDESD	241024	AAA(mex)	\$58,076,383	0.06 %
LD	BONDESD	221013	AAA(mex)	\$20,349,624	0.02 %
LD	BONDESD	220714	AAA(mex)	\$110,334	0.00 %
Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LF				\$11,168,903,553	12.22 %
LF	BONDESF	230202	AAA(mex)	\$3,689,956,583	4.04 %
LF	BONDESF	230302	AAA(mex)	\$1,697,193,211	1.86 %
LF	BONDESF	230330	AAA(mex)	\$1,561,948,346	1.71 %
LF	BONDESF	231005	AAA(mex)	\$941,672,909	1.03 %
LF	BONDESF	221006	AAA(mex)	\$852,495,150	0.93 %
LF	BONDESF	221201	AAA(mex)	\$802,260,496	0.88 %
LF	BONDESF	231130	AAA(mex)	\$801,186,224	0.88 %
LF	BONDESF	230622	AAA(mex)	\$450,510,611	0.49 %
LF	BONDESF	221103	AAA(mex)	\$220,632,179	0.24 %
LF	BONDESF	250227	AAA(mex)	\$151,047,844	0.17 %
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Mensual)				\$8,777,444,978	9.60 %
IM	BPAG28	220811	AAA(mex)	\$1,253,318,375	1.37 %
IM	BPAG28	230810	AAA(mex)	\$1,126,654,931	1.23 %
IM	BPAG28	240509	AAA(mex)	\$1,121,605,094	1.23 %
IM	BPAG28	231109	AAA(mex)	\$1,119,703,110	1.22 %
IM	BPAG28	240208	AAA(mex)	\$1,112,670,609	1.22 %
IM	BPAG28	230209	AAA(mex)	\$1,089,625,716	1.19 %
IM	BPAG28	230511	AAA(mex)	\$1,073,740,121	1.17 %
IM	BPAG28	240808	AAA(mex)	\$369,715,907	0.40 %
IM	BPAG28	221110	AAA(mex)	\$325,883,742	0.36 %
IM	BPAG28	241107	AAA(mex)	\$184,527,373	0.20 %
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)				\$603,447,350	0.66 %



T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
IQ	BPAG91	230427	AAA(mex)	\$202,234,106	0.22 %
IQ	BPAG91	220825	AAA(mex)	\$201,275,154	0.22 %
IQ	BPAG91	221229	AAA(mex)	\$199,938,090	0.22 %
Total Deuda Gubernamental				\$25,199,054,150	27.57 %
Deuda Bancaria					
Certificados Bursátiles Bancarios				\$378,419,074	0.41 %
94	BACOMER	20-2	AAA (mex)	\$130,335,102	0.14 %
94	BSMX	21	AAA (mex)	\$100,367,333	0.11 %
94	BSMX	22	AAA (mex)	\$100,060,069	0.11 %
94	SCOTIAB	19-2	AAA (mex)	\$47,656,570	0.05 %
Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo				\$1,223,533,119	1.34 %
CD	SHF	21	AAA (mex)	\$190,227,717	0.21 %
CD	NAFR	240628	mxAAA	\$170,921,453	0.19 %
CD	BACMEXT	20	AAA (mex)	\$120,722,134	0.13 %
CD	BACMEXT	21	mxAAA	\$120,386,772	0.13 %
CD	BANO	22	AAA (mex)	\$120,015,846	0.13 %
CD	NAFR	241118	mxAAA	\$100,491,189	0.11 %
CD	BACMEXT	21X	AAA (mex)	\$100,362,855	0.11 %
CD	NAFR	220722	mxAAA	\$100,107,119	0.11 %
CD	SHF	17-2	AAA (mex)	\$90,040,876	0.10 %
CD	SHF	18-3	AAA (mex)	\$60,129,373	0.07 %
CD	NAFR	17S	AAA (mex)	\$50,127,785	0.05 %
Certificados de Depósito				\$1,754,936,415	1.92 %
F	BANSAN	22020	F1+ (mex)	\$904,038,084	0.99 %
F	BANSAN	22002	F1+ (mex)	\$850,898,331	0.93 %
Pagaré con Rendimiento Liquidable al Vencimiento				\$3,485,757,300	3.81 %
I	BANOBR	22265	F1+ (mex)	\$2,500,543,066	2.74 %
I	BACMEXT	22265	F1+ (mex)	\$985,214,234	1.08 %
Total Deuda Bancaria				\$6,842,645,908	7.49 %
Otros Títulos de Deuda					
Acciones de Fondos de Inversión de Deuda				\$14,196,006,671	15.53 %
51	NTEGUB	FF	AAAf/S1 (mex)	\$13,425,739,222	14.69 %
51	NTEGUB+	FF	AAAf/S2 (mex)	\$770,267,449	0.84 %
Certificados Bursátiles Corporativos				\$0	0.00 %
91	CASITA	11	D (mex)	\$0	0.00 %
Total Otros Títulos de Deuda				\$14,196,006,671	15.53 %
TOTAL DE TÍTULOS PARA NEGOCIAR				\$46,237,706,729	50.58 %
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES				\$46,237,706,729	50.58 %
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADOR					
Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LD				\$3,113,252,962	3.41 %
LD	BONDESD	230309	AAA(mex)	\$1,597,293,754	1.75 %
LD	BONDESD	220714	AAA(mex)	\$661,090,264	0.72 %
LD	BONDESD	251016	AAA(mex)	\$500,109,084	0.55 %
LD	BONDESD	250814	AAA(mex)	\$200,043,421	0.22 %
LD	BONDESD	240425	AAA(mex)	\$99,704,493	0.11 %
LD	BONDESD	240822	AAA(mex)	\$55,011,946	0.06 %
Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LF				\$26,357,729,656	28.83 %
LF	BONDESF	240201	AAA(mex)	\$4,615,578,391	5.05 %
LF	BONDESF	290322	AAA(mex)	\$3,883,882,784	4.25 %
LF	BONDESF	241003	AAA(mex)	\$3,405,533,074	3.73 %



T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
LF	BONDESF	250102	AAA(mex)	\$2,493,071,962	2.73 %
LF	BONDESF	250424	AAA(mex)	\$2,440,618,613	2.67 %
LF	BONDESF	270225	AAA(mex)	\$2,232,771,108	2.44 %
LF	BONDESF	270422	AAA(mex)	\$1,934,527,864	2.12 %
LF	BONDESF	250227	AAA(mex)	\$1,276,132,381	1.40 %
LF	BONDESF	241128	AAA(mex)	\$1,134,028,334	1.24 %
LF	BONDESF	240425	AAA(mex)	\$998,941,948	1.09 %
LF	BONDESF	231005	AAA(mex)	\$550,839,408	0.60 %
LF	BONDESF	240425	AAA(mex)	\$499,513,115	0.55 %
LF	BONDESF	241128	AAA(mex)	\$499,281,971	0.55 %
LF	BONDESF	241003	AAA(mex)	\$350,360,260	0.38 %
LF	BONDESF	240321	AAA(mex)	\$42,648,443	0.05 %
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Mensual)				\$3,360,956,169	3.68 %
IM	BPAG28	241107	AAA(mex)	\$1,106,198,800	1.21 %
IM	BPAG28	221110	AAA(mex)	\$500,703,536	0.55 %
IM	BPAG28	240808	AAA(mex)	\$500,108,651	0.55 %
IM	BPAG28	240808	AAA(mex)	\$500,108,651	0.55 %
IM	BPAG28	240808	AAA(mex)	\$366,297,899	0.40 %
IM	BPAG28	230511	AAA(mex)	\$200,635,671	0.22 %
IM	BPAG28	241107	AAA(mex)	\$186,902,961	0.20 %
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Semestral)				\$1,575,917,632	1.72 %
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	\$1,021,585,697	1.12 %
IS	BPA182	240307	AAA(mex)	\$480,016,051	0.53 %
IS	BPA182	220908	AAA(mex)	\$74,315,884	0.08 %
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)				\$5,431,529,968	5.94 %
IQ	BPAG91	240502	AAA(mex)	\$1,881,823,247	2.06 %
IQ	BPAG91	240829	AAA(mex)	\$1,536,820,978	1.68 %
IQ	BPAG91	260507	AAA(mex)	\$1,335,791,557	1.46 %
IQ	BPAG91	260903	AAA(mex)	\$606,039,745	0.66 %
IQ	BPAG91	250102	AAA(mex)	\$71,054,441	0.08 %
Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo				\$700,153,072	0.77 %
CD	BACMEXT	21	mxAAA	\$250,054,769	0.27 %
CD	BACMEXT	21-2	mxAAA	\$250,054,579	0.27 %
CD	BANOB	20-2X	AAA (mex)	\$100,021,915	0.11 %
CD	SHF	21-4	AAA (mex)	\$100,021,809	0.11 %
Certificados de la Tesorería de la Federación				\$762,502,720	0.83 %
BI	CETES	221117	AAA(mex)	\$367,868,065	0.40 %
BI	CETES	221117	AAA(mex)	\$250,053,815	0.27 %
BI	CETES	220901	AAA(mex)	\$133,010,535	0.15 %
BI	CETES	220728	AAA(mex)	\$11,570,305	0.01 %
TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE				\$41,302,042,179	45.18 %
TOTAL DE CARTERA:				\$91,415,102,396	100.00%
Límite Máximo de VaR: 0.050%				VaR Promedio: 0.0006%	
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.					
El Fondo no realizará estrategias temporales de Inversión.					
51	NTEGUB	https://www.banorte.com/cms/casadebolsabanorteixe/fondosdeinversion/informacion-particular/semanales/NTEGUB_SEMANAL.pdf?1567529109809			

