

Composición de la Cartera de Inversión al 27 de marzo de 2024.

NTEDIG						
Fondo Banorte 40, 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	
EFFECTIVO Y EQUIVALENTES DE EFFECTIVO						
Chequera en Pesos				\$32,956,248	0.33 %	
CHM	040072	7423301	N/A	\$32,956,248	0.33 %	
TOTAL DE EFFECTIVO Y EQUIVALENTES DE EFFECTIVO				\$32,956,248	0.33 %	
INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS						
INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES						
Deuda Gubernamental						
Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LF				\$150,461,805	1.50 %	
LF	BONDES	241024	AAA(mex)	\$40,203,361	0.40 %	
LF	BONDES	241003	AAA(mex)	\$40,115,484	0.40 %	
LF	BONDES	240425	AAA(mex)	\$40,058,790	0.40 %	
LF	BONDES	241128	AAA(mex)	\$30,084,170	0.30 %	
Total Deuda Gubernamental				\$150,461,805	1.50 %	
Deuda Bancaria						
Certificados Bursátiles Bancarios				\$15,088,546	0.15 %	
94	BSMX	21	AAA (mex)	\$10,042,483	0.10 %	
94	BACOMER	20-2	AAA (mex)	\$5,046,063	0.05 %	
Total Deuda Bancaria				\$15,088,546	0.15 %	
Otros Títulos de Deuda						
Acciones de Fondos de Inversión de Deuda				\$7,603,535,271	75.58 %	
51	NTECT	FF	AAAf/S1 (mex)	\$7,603,535,271	75.58 %	
Total Otros Títulos de Deuda				\$7,603,535,271	75.58 %	
TOTAL DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES				\$7,769,085,622	77.22 %	
TOTAL DE INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS				\$7,769,085,622	77.22 %	
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADOR						
Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LF				\$1,857,668,255	18.47 %	
LF	BONDES	260226	AAA(mex)	\$1,001,545,775	9.96 %	
LF	BONDES	270617	AAA(mex)	\$428,061,835	4.25 %	
LF	BONDES	270318	AAA(mex)	\$428,060,645	4.25 %	
Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo				\$400,622,207	3.98 %	
CD	BANOB	22-4	AAA (mex)	\$301,786,451	3.00 %	
CD	NAFR	260626	AAA (mex)	\$98,835,756	0.98 %	
TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTO				\$2,258,290,462	22.45 %	
TOTAL DE CARTERA:				\$10,060,332,332	100.00%	
Límite Máximo de VaR: 0.050%				VaR Promedio: 0.0108%		
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.						
El Fondo no realizará estrategias temporales de Inversión.						



51	NTECT	https://www.banorte.com/cms/casadebolsabanorteixe/fondosdeinversion/informacionparticular/semanales/NTECT_SEMANAL.pdf?1689080040725
----	-------	---

