

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

<b>NTEDIG</b>					
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
<b>EFFECTIVO Y EQUIVALENTES DE EFFECTIVO</b>					
	<b>Chequera en Pesos</b>			<b>\$79,204,102</b>	<b>0.66 %</b>
CHM	040072	7423301	N/A	\$79,204,102	0.66 %
	<b>TOTAL DE EFFECTIVO Y EQUIVALENTES DE EFFECTIVO</b>			<b>\$79,204,102</b>	<b>0.66 %</b>
<b>INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS</b>					
<b>INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES</b>					
<b>Deuda Gubernamental</b>					
	<b>Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LF</b>			<b>\$110,660,107</b>	<b>0.93 %</b>
LF	BONDESF	241024	AAA(mex)	\$40,295,082	0.34 %
LF	BONDESF	241003	AAA(mex)	\$40,210,446	0.34 %
LF	BONDESF	241128	AAA(mex)	\$30,154,579	0.25 %
	<b>Total Deuda Gubernamental</b>			<b>\$110,660,107</b>	<b>0.93 %</b>
<b>Deuda Bancaria</b>					
	<b>Certificados Bursátiles Bancarios</b>			<b>\$15,075,481</b>	<b>0.13 %</b>
94	BSMX	21	AAA (mex)	\$10,064,004	0.08 %
94	BACOMER	20-2	AAA (mex)	\$5,011,477	0.04 %
	<b>Total Deuda Bancaria</b>			<b>\$15,075,481</b>	<b>0.13 %</b>
<b>Otros Títulos de Deuda</b>					
	<b>Acciones de Fondos de Inversión de Deuda</b>			<b>\$9,222,912,798</b>	<b>77.22 %</b>
51	NTECT	FF	AAAf/S1 (mex)	\$9,222,912,798	77.22 %
	<b>Total Otros Títulos de Deuda</b>			<b>\$9,222,912,798</b>	<b>77.22 %</b>
<b>TOTAL DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES</b>				<b>\$9,348,648,386</b>	<b>78.28 %</b>
<b>TOTAL DE INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS</b>				<b>\$9,348,648,386</b>	<b>78.28 %</b>
<b>OPERACIONES DE REPORTO REPORTADOR</b>					
	<b>Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LF</b>			<b>\$1,557,989,758</b>	<b>13.04 %</b>
LF	BONDESF	250619	AAA(mex)	\$1,000,924,960	8.38 %
LF	BONDESF	271014	AAA(mex)	\$557,064,798	4.66 %
	<b>Bonos de Protección al Ahorro (Pago Semestral)</b>			<b>\$557,064,768</b>	<b>4.66 %</b>
IS	BPA182	300328	AAA(mex)	\$557,064,768	4.66 %
	<b>Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo</b>			<b>\$400,371,639</b>	<b>3.35 %</b>
CD	BANOB	22-4	AAA (mex)	\$299,453,173	2.51 %
CD	NAFR	260626	AAA (mex)	\$100,918,466	0.84 %
	<b>TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTO</b>			<b>\$2,515,426,165</b>	<b>21.06 %</b>
<b>TOTAL DE CARTERA:</b>				<b>\$11,943,278,653</b>	<b>100.00%</b>
<b>Límite Máximo de VaR: 0.050%</b>				<b>VaR Promedio: 0.0119%</b>	
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.					
<b>El Fondo no realizará estrategias temporales de Inversión.</b>					



51	NTECT	<a href="https://www.banorte.com/cms/casadebolsabanorteixe/fondosdeinversion/informacionparticular/semanales/NTECT_SEMANAL.pdf?1689080040725">https://www.banorte.com/cms/casadebolsabanorteixe/fondosdeinversion/informacionparticular/semanales/NTECT_SEMANAL.pdf?1689080040725</a>
----	-------	---

