

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

<b>NTEEURO</b>					
Fondo Banorte 21, S.A de C.V. Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda					
Categoría: Corto Plazo Moneda Extranjera					
Calificación: AAAf/S5(mex)					
T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
<b>DISPONIBILIDADES</b>					
	<b>Chequera en Euros</b>			<b>\$136,279,121</b>	<b>99.26 %</b>
CHE	40-012	2742284	N/A	\$136,279,121	99.26 %
	<b>Chequera en Pesos</b>			<b>\$15,000</b>	<b>0.01 %</b>
CHM	40-012	2742136	N/A	\$15,000	0.01 %
	<b>TOTAL DE DISPONIBILIDADES</b>			<b>\$136,294,121</b>	<b>99.28 %</b>
<b>OPERACIONES DE REPORTE</b>					
<b>REPORTADOR</b>					
	<b>Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)</b>			<b>\$995,002</b>	<b>0.72 %</b>
IQ	BPAG91	260903	AAA(mex)	\$995,002	0.72 %
	<b>TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE</b>			<b>\$995,002</b>	<b>0.72 %</b>
	<b>TOTAL DE CARTERA:</b>			<b>\$137,289,123</b>	<b>100.00%</b>
Límite Máximo de VaR: 2.580%			VaR Promedio: 1.4571%		
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.					
Actualmente el Fondo no se encuentra en estrategia temporal de inversión.					

