

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

NTEEURO					
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
EFFECTIVO Y EQUIVALENTES DE EFFECTIVO					
	Chequera en Euros			\$81,317,706	99.84 %
CHE	40-012	2742284	N/A	\$81,317,706	99.84 %
	Chequera en Pesos			\$15,000	0.02 %
CHM	40-012	2742136	N/A	\$15,000	0.02 %
	TOTAL DE EFFECTIVO Y EQUIVALENTES DE EFFECTIVO			\$81,332,706	99.86 %
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADOR					
	Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)			\$112,137	0.14 %
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	\$112,137	0.14 %
	TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE			\$112,137	0.14 %
	TOTAL DE CARTERA:			\$81,444,843	100.00%
Límite Máximo de VaR: 2.580%			VaR Promedio: 1.3193%		
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.					

