

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

NTEMXN					
Fondo Banorte 39, S.A. de C.V. Fondo de Inversión de Renta Variable					
Categoría: Discrecional					
T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
DISPONIBILIDADES					
Chequera en Pesos				\$4,015,023	0.36 %
CHM	040072	9385896	N/A	\$4,015,023	0.36 %
TOTAL DE DISPONIBILIDADES				\$4,015,023	0.36 %
INVERSIONES EN VALORES					
TÍTULOS PARA NEGOCIAR					
Instrumentos de Patrimonio Neto					
Títulos Referenciados a Acciones, TRACS Extranjeros				\$1,121,128,600	99.64 %
1ISP	IB1MXX	N	Alta	\$834,641,004	74.18 %
1ISP	MB3M	N	Alta	\$112,781,295	10.02 %
1ISP	MBIL	N	Alta	\$56,469,295	5.02 %
1ISP	FRMXNX	N	Alta	\$56,342,951	5.01 %
1ISP	IEGMX	N	Alta	\$56,061,100	4.98 %
1ISP	PFF	*	Alta	\$4,832,955	0.43 %
Total Instrumentos de Patrimonio Neto				\$1,121,128,600	99.64 %
TOTAL DE TÍTULOS PARA NEGOCIAR				\$1,121,128,600	99.64 %
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES				\$1,121,128,600	99.64 %
TOTAL DE CARTERA:				\$1,125,143,623	100.00%
Límite Máximo de VaR: 1.800%			VaR Promedio: 0.2031%		
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.					
1ISP	IB1MXX	https://www.ishares.com/ch/institutional/en/products/308634/ishares-treasury-bond-0-1yr-ucits-etf-mxn-hedged-acc-fund			
1ISP	MB3M	https://am.jpmorgan.com/mx/en/asset-management/adv/products/jpm-betabuilders-us-treasury-bond-0-3-months-ucits-etf-mxn-hedged-acc-ie00bmd8kn73			

