

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

<b>NTEPZO4</b>					
Fondo Banorte 42, S.A. de C.V. Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda					
Categoría: Corto Plazo					
Calificación: AAAf/S1					
T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
<b>EFFECTIVO Y EQUIVALENTES DE EFFECTIVO</b>					
	<b>Chequera en Pesos</b>			<b>\$3,371,265,561</b>	<b>99.53 %</b>
CHM	040072	2905082	N/A	\$3,371,265,561	99.53 %
	<b>TOTAL DE EFFECTIVO Y EQUIVALENTES DE EFFECTIVO</b>			<b>\$3,371,265,561</b>	<b>99.53 %</b>
<b>OPERACIONES DE REPORTO</b>					
<b>REPORTADOR</b>					
	<b>Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LF</b>			<b>\$15,972,426</b>	<b>0.47 %</b>
LF	BONDESF	270318	AAA(mex)	\$15,972,426	0.47 %
	<b>TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTO</b>			<b>\$15,972,426</b>	<b>0.47 %</b>
	<b>TOTAL DE CARTERA:</b>			<b>\$3,387,237,987</b>	<b>100.00%</b>
Límite Máximo de VaR: 0.040%			VaR Promedio: 0.0000%		
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>					
<i>De acuerdo al objetivo de inversión del Fondo, actualmente se encuentra en Periodo de Inversión (del jueves 14 de marzo de 2024 al jueves 13 de junio de 2024)</i>					

