

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

NTEPZO4					
Fondo Banorte 42, S.A. de C.V. Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda					
Categoría: Corto Plazo					
Calificación: AA Af/S1					
T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
EFFECTIVO Y EQUIVALENTES DE EFFECTIVO					
	Chequera en Pesos			\$3,438,515,944	99.81 %
CHM	040072	2905082	N/A	\$3,438,515,944	99.81 %
	TOTAL DE EFFECTIVO Y EQUIVALENTES DE EFFECTIVO			\$3,438,515,944	99.81 %
OPERACIONES DE REPORTO					
REPORTADOR					
	Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LF			\$6,711,043	0.19 %
LF	BONDES F	290322	AAA(mex)	\$6,710,944	0.19 %
LF	BONDES F	321021	AAA(mex)	\$99	0.00 %
	TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTO			\$6,711,043	0.19 %
	TOTAL DE CARTERA:			\$3,445,226,987	100.00%
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.					
El Fondo no realizará estrategias temporales de Inversión.					
<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>					

