

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

NTESEL					
Fondo Banorte 22, S.A. de C.V. Fondo de Inversión de Renta Variable					
Categoría: Especializado en Acciones					
T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
EFFECTIVO Y EQUIVALENTES DE EFFECTIVO					
Chequera en Pesos				\$102	0.00 %
CHM	040072	7838671	N/A	\$102	0.00 %
TOTAL DE EFFECTIVO Y EQUIVALENTES DE EFFECTIVO				\$102	0.00 %
INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS					
INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES					
Instrumentos financieros de capital					
Acciones Industriales, Comerciales y de Servicios				\$917,633,121	98.07 %
1	GMEXICO	B	Alta	\$103,904,196	11.10 %
1	GFNORTE	O	Alta	\$101,501,246	10.85 %
1	FEMSA	UBD	Alta	\$100,343,732	10.72 %
1	AMX	B	Alta	\$98,957,400	10.58 %
1	LAB	B	Alta	\$66,726,350	7.13 %
1	GCC	*	Alta	\$65,844,327	7.04 %
1	BIMBO	A	Alta	\$56,542,650	6.04 %
1	VOLAR	A	Alta	\$51,189,014	5.47 %
1	CHDRAUI	B	Alta	\$50,220,000	5.37 %
1	NEMAK	A	Media	\$48,967,380	5.23 %
1	ALPEK	A	Alta	\$40,992,000	4.38 %
1	ALSEA	*	Alta	\$39,675,562	4.24 %
1	BOLSA	A	Alta	\$33,432,500	3.57 %
1	GENTERA	*	Alta	\$31,297,339	3.34 %
1	LIVEPOL	C-1	Alta	\$28,039,425	3.00 %
Total instrumentos financieros de capital				\$917,633,121	98.07 %
TOTAL DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES				\$917,633,121	98.07 %
TOTAL DE INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS				\$917,633,121	98.07 %
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADOR					
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)				\$18,071,659	1.93 %
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	\$18,071,659	1.93 %
TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE				\$18,071,659	1.93 %
TOTAL DE CARTERA:				\$935,704,882	100.00%
Límite Máximo de VaR: 3.400%			VaR Promedio: 1.7670%		
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.					

