

Composición de la Cartera de Inversión al 16 de junio de 2022.

| APIDINT | | | | | |
|--|----------------------------------|---------|-----------------------|--------------------------|--------------------|
| Fondo Banorte 38, S.A. de C.V. Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda | | | | | |
| Categoría: Discrecional | | | | | |
| Calificación: AAF/S7 | | | | | |
| T. VALOR | EMISORA | SERIE | CALIF/BURS | VALOR RAZONABLE TOTAL | % PARTICIPACIÓN |
| DISPONIBILIDADES | | | | | |
| | Chequera en Pesos | | | \$1,979,827 | 100.00 % |
| CHM | 040072 | 9388543 | N/A | \$1,979,827 | 100.00 % |
| | TOTAL DE DISPONIBILIDADES | | | \$1,979,827 | 100.00 % |
| | TOTAL DE CARTERA: | | | \$1,979,827 | 100.00% |
| Límite Máximo de VaR: 3.180% | | | 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 500 observaciones. | | | | | |
| El Fondo no realizará estrategias temporales de Inversión. | | | | | |

