

Composición de la Cartera de Inversión al 18 de abril de 2024.

NTE2					
Fondo Banorte 16, S.A. de C.V. Fondo de Inversión de Renta Variable					
Categoría: Discrecional					
T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
EFFECTIVO Y EQUIVALENTES DE EFFECTIVO					
Chequera en Pesos				\$1	0.00 %
CHM	040072	7144822	N/A	\$1	0.00 %
TOTAL DE EFFECTIVO Y EQUIVALENTES DE EFFECTIVO				\$1	0.00 %
INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS					
INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES					
Otros Títulos de Deuda					
Acciones de Fondos de Inversión de Deuda				\$110,885,267	34.80 %
51	NTEMPG	FF	AAAf/S4 (mex)	\$59,847,066	18.78 %
51	NTELP	FF	AAAf/S5 (mex)	\$39,671,038	12.45 %
51	NTED	FF	AAAf/S4 (mex)	\$11,367,163	3.57 %
Total Otros Títulos de Deuda				\$110,885,267	34.80 %
Instrumentos financieros de capital					
Acciones de Fondos de Inversión de Renta Variable				\$121,884,165	38.25 %
52	NTESEL	FF	N/A	\$30,424,451	9.55 %
52	NTEIPC+	FF	N/A	\$24,775,370	7.77 %
52	NTEUSA	FF	N/A	\$12,451,259	3.91 %
52	NTEINT+	FF	N/A	\$11,363,975	3.57 %
52	NTEDLS+	FF	N/A	\$10,678,546	3.35 %
52	NTEMXN	FF	N/A	\$9,364,842	2.94 %
52	NTERT	FF	N/A	\$6,979,039	2.19 %
52	NTEESG	FF	N/A	\$5,756,985	1.81 %
52	NTEUSA+	FF	N/A	\$5,130,004	1.61 %
52	NTEAI	FF	N/A	\$4,959,694	1.56 %
Títulos Referenciados a Acciones, TRACS Extranjeros				\$85,877,761	26.95 %
1ISP	FLOA	N	Alta	\$19,302,774	6.06 %
1ISP	LQDA	N	Alta	\$14,267,652	4.48 %
1ISP	SUAS	N	Alta	\$13,755,068	4.32 %
1ISP	VEU	*	Alta	\$13,120,257	4.12 %
1ISP	AGG	*	Alta	\$11,787,234	3.70 %
1ISP	MBB	*	Alta	\$3,493,716	1.10 %
1ISP	XSOE	*	Alta	\$3,262,930	1.02 %
1ISP	DGRO	*	Alta	\$2,517,481	0.79 %
1ISP	SPSB	*	Alta	\$1,368,502	0.43 %
1ISP	SPIB	*	Alta	\$1,026,955	0.32 %
1ISP	SPLB	*	Alta	\$1,001,847	0.31 %
1ISP	LQD	*	Alta	\$973,345	0.31 %
Total instrumentos financieros de capital				\$207,761,926	65.20 %
TOTAL DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES				\$318,647,193	100.00 %
TOTAL DE INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS				\$318,647,193	100.00 %
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADOR					

T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
	Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LF			\$9,750	0.00 %
LF	BONDEF	250424	AAA(mex)	\$9,750	0.00 %
TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTO				\$9,750	0.00 %
TOTAL DE CARTERA:				\$318,656,944	100.00%
Límite Máximo de VaR: 1.100%			VaR Promedio: 0.5573%		
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.					
51	NTEMPG	https://www.banorte.com/cms/casadebolsabanorteixe/fondosdeinversion/informacionparticular/semanales/NTEMPG_SEMANAL.pdf?1689080040725			
51	NTELP	https://www.banorte.com/cms/casadebolsabanorteixe/fondosdeinversion/informacionparticular/semanales/NTELP_SEMANAL.pdf?1689080040725			

