

Composición de la Cartera de Inversión al 30 de junio de 2022.

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
INVERSIONES EN VALORES					
TÍTULOS PARA NEGOCIAR					
Otros Títulos de Deuda					
Acciones de Fondos de Inversión de Deuda				\$188,204,243	31.33 %
51	NTED	FF	AAAf/S4 (mex)	\$107,186,505	17.84 %
51	NTEMPG	FF	AAAf/S4 (mex)	\$52,244,642	8.70 %
51	NTELP	FF	AAAf/S5 (mex)	\$28,773,096	4.79 %
Total Otros Títulos de Deuda				\$188,204,243	31.33 %
Instrumentos de Patrimonio Neto					
Acciones de Fondos de Inversión de Renta Variable				\$198,392,688	33.02 %
52	NTEIPC+	FF	N/A	\$51,238,757	8.53 %
52	NTESEL	FF	N/A	\$47,803,503	7.96 %
52	NTEUSA	FF	N/A	\$33,288,698	5.54 %
52	NTERT	FF	N/A	\$20,120,467	3.35 %
52	NTEUSA+	FF	N/A	\$15,234,178	2.54 %
52	NTEESG	FF	N/A	\$14,290,436	2.38 %
52	NTEDLS+	FF	N/A	\$5,521,140	0.92 %
52	NTEINT+	FF	N/A	\$5,485,756	0.91 %
52	NTEAI	FF	N/A	\$5,409,753	0.90 %
Títulos Referenciados a Acciones, TRACS Extranjeros				\$213,981,938	35.62 %
1ISP	VEU	*	Alta	\$37,113,873	6.18 %
1ISP	SGOV	*	Alta	\$34,970,619	5.82 %
1ISP	AGG	*	Alta	\$31,428,982	5.23 %
1ISP	XSOE	*	Alta	\$21,929,818	3.65 %
1ISP	SUAS	N	Alta	\$18,505,729	3.08 %
1ISP	IB1MXX	N	Alta	\$12,936,879	2.15 %
1ISP	CYBA	N	Alta	\$12,172,983	2.03 %
1ISP	LQDA	N	Alta	\$9,865,383	1.64 %
1ISP	SJNK	*	Alta	\$7,707,479	1.28 %
1ISP	VTIP	*	Alta	\$7,013,810	1.17 %
1ISP	STIP	*	Alta	\$6,970,450	1.16 %
1ISP	MBB	*	Alta	\$4,481,507	0.75 %
1ISP	DGRO	*	Alta	\$3,526,187	0.59 %
1ISP	SPSB	*	Alta	\$1,626,457	0.27 %
1ISP	SPLB	*	Alta	\$1,292,683	0.22 %
1ISP	SPIB	*	Alta	\$1,233,874	0.21 %
1ISP	LQD	*	Alta	\$1,205,225	0.20 %
Total Instrumentos de Patrimonio Neto				\$412,374,626	68.64 %
TOTAL DE TÍTULOS PARA NEGOCIAR				\$600,578,869	99.97 %
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES				\$600,578,869	99.97 %
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADOR					
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)				\$199,861	0.03 %
IQ	BPAG91	260903	AAA(mex)	\$199,861	0.03 %



T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTO				\$199,861	0.03 %
TOTAL DE CARTERA:				\$600,778,730	100.00%
Límite Máximo de VaR: 1.100%			VaR Promedio: 0.6380%		
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.					
Actualmente el Fondo no se encuentra en estrategia temporal de inversión.					
51	NTED	https://www.banorte.com/cms/casadebolsabanorteixe/fondosdeinversion/informacionparticular/semanales/NTED_SEMANAL.pdf?1567528885975			

