

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

NTEDIG					
Fondo Banorte 40, S.A. de C.V. Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda					
Categoría: Corto Plazo					
Calificación: AA Af/S1 (mex)					
T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
DISPONIBILIDADES					
	Chequera en Pesos			\$17,966,020	1.92 %
CHM	040072	7423301	N/A	\$17,966,020	1.92 %
	TOTAL DE DISPONIBILIDADES			\$17,966,020	1.92 %
INVERSIONES EN VALORES					
TÍTULOS PARA NEGOCIAR					
Deuda Gubernamental					
	Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LD			\$10,016,727	1.07 %
LD	BONDESD	220721	AAA(mex)	\$10,016,727	1.07 %
	Total Deuda Gubernamental			\$10,016,727	1.07 %
Deuda Bancaria					
	Certificados Bursátiles Bancarios			\$20,053,627	2.14 %
94	BSMX	21	AAA (mex)	\$10,036,733	1.07 %
94	BACOMER	20-2	AAA (mex)	\$5,012,889	0.53 %
94	BACOMER	20	AAA (mex)	\$5,004,005	0.53 %
	Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo			\$30,093,634	3.21 %
CD	BACMEXT	20	AAA (mex)	\$10,060,177	1.07 %
CD	SHF	21	AAA (mex)	\$10,011,985	1.07 %
CD	BACMEXT	21	mxAAA	\$5,016,116	0.53 %
CD	NAFR	220722	mxAAA	\$5,005,356	0.53 %
	Certificados de Depósito			\$10,045,547	1.07 %
F	BANSAN	22003	F1+ (mex)	\$10,045,547	1.07 %
	Total Deuda Bancaria			\$60,192,808	6.42 %
Otros Títulos de Deuda					
	Acciones de Fondos de Inversión de Deuda			\$604,557,933	64.47 %
51	NTECT	FF	AA Af/S1 (mex)	\$604,557,933	64.47 %
	Total Otros Títulos de Deuda			\$604,557,933	64.47 %
	TOTAL DE TÍTULOS PARA NEGOCIAR			\$674,767,468	71.95 %
	TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES			\$674,767,468	71.95 %
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADOR					
	Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LD			\$245,053,213	26.13 %
LD	BONDESD	240822	AAA(mex)	\$245,053,213	26.13 %
	TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE			\$245,053,213	26.13 %
	TOTAL DE CARTERA:			\$937,786,701	100.00%
Límite Máximo de VaR: 0.050% VaR Promedio: 0.0060%					
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.					
51	NTECT	https://www.banorte.com/cms/casadebolsabanorteixe/fondosdeinversion/informacionparticular/semanales/NTECT_SEMANAL.pdf?1567450118133			

