

**Composición de la Cartera de Inversión al 13 de junio de 2024.**

<b>NTEDIG</b>					
Fondo Banorte 40, S.A. de C.V. Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda					
Categoría: Corto Plazo					
Calificación: AAAf/S1(mex)					
T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
<b>EFFECTIVO Y EQUIVALENTES DE EFFECTIVO</b>					
	<b>Chequera en Pesos</b>			<b>\$59,310,872</b>	<b>0.48 %</b>
CHM	040072	7423301	N/A	\$59,310,872	0.48 %
	<b>TOTAL DE EFFECTIVO Y EQUIVALENTES DE EFFECTIVO</b>			<b>\$59,310,872</b>	<b>0.48 %</b>
<b>INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS</b>					
<b>INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES</b>					
<b>Deuda Gubernamental</b>					
	<b>Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LF</b>			<b>\$110,088,711</b>	<b>0.88 %</b>
LF	BONDESF	241024	AAA(mex)	\$40,086,809	0.32 %
LF	BONDESF	241003	AAA(mex)	\$40,002,959	0.32 %
LF	BONDESF	241128	AAA(mex)	\$29,998,943	0.24 %
	<b>Total Deuda Gubernamental</b>			<b>\$110,088,711</b>	<b>0.88 %</b>
<b>Deuda Bancaria</b>					
	<b>Certificados Bursátiles Bancarios</b>			<b>\$15,039,479</b>	<b>0.12 %</b>
94	BSMX	21	AAA (mex)	\$10,010,763	0.08 %
94	BACOMER	20-2	AAA (mex)	\$5,028,716	0.04 %
	<b>Total Deuda Bancaria</b>			<b>\$15,039,479</b>	<b>0.12 %</b>
<b>Otros Títulos de Deuda</b>					
	<b>Acciones de Fondos de Inversión de Deuda</b>			<b>\$10,396,990,862</b>	<b>83.53 %</b>
51	NTECT	FF	AAAf/S1 (mex)	\$10,396,990,862	83.53 %
	<b>Total Otros Títulos de Deuda</b>			<b>\$10,396,990,862</b>	<b>83.53 %</b>
<b>TOTAL DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES</b>				<b>\$10,522,119,052</b>	<b>84.54 %</b>
<b>TOTAL DE INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS</b>				<b>\$10,522,119,052</b>	<b>84.54 %</b>
<b>OPERACIONES DE REPORTO REPORTADOR</b>					
	<b>Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LF</b>			<b>\$1,232,876,478</b>	<b>9.91 %</b>
LF	BONDESF	250619	AAA(mex)	\$1,000,305,528	8.04 %
LF	BONDESF	270318	AAA(mex)	\$232,570,950	1.87 %
	<b>Bonos de Protección al Ahorro (Pago Mensual)</b>			<b>\$232,571,011</b>	<b>1.87 %</b>
IM	BPAG28	261105	AAA(mex)	\$232,571,011	1.87 %
	<b>Certificados Bursátiles de Banca de Desarrollo</b>			<b>\$400,122,717</b>	<b>3.21 %</b>
CD	BANOB	22-4	AAA (mex)	\$300,466,046	2.41 %
CD	NAFR	260626	AAA (mex)	\$99,656,671	0.80 %
	<b>TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTO</b>			<b>\$1,865,570,206</b>	<b>14.99 %</b>
<b>TOTAL DE CARTERA:</b>				<b>\$12,447,000,130</b>	<b>100.00%</b>
<b>Límite Máximo de VaR: 0.050%</b>				<b>VaR Promedio: 0.0131%</b>	
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.					
<b>El Fondo no realizará estrategias temporales de Inversión.</b>					



51	NTECT	<a href="https://www.banorte.com/cms/casadebolsabanorteixe/fondosdeinversion/informacionparticular/semanales/NTECT_SEMANAL.pdf?1689080040725">https://www.banorte.com/cms/casadebolsabanorteixe/fondosdeinversion/informacionparticular/semanales/NTECT_SEMANAL.pdf?1689080040725</a>
----	-------	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

