

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

NTEEURO					
Fondo Banorte 21, S.A de C.V. Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda					
Categoría: Corto Plazo Moneda Extranjera					
Calificación: AAAf/S5(mex)					
T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
DISPONIBILIDADES					
	Chequera en Euros			\$136,279,121	99.26 %
CHE	40-012	2742284	N/A	\$136,279,121	99.26 %
	Chequera en Pesos			\$15,000	0.01 %
CHM	40-012	2742136	N/A	\$15,000	0.01 %
	TOTAL DE DISPONIBILIDADES			\$136,294,121	99.28 %
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADOR					
	Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)			\$995,002	0.72 %
IQ	BPAG91	260903	AAA(mex)	\$995,002	0.72 %
	TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE			\$995,002	0.72 %
	TOTAL DE CARTERA:			\$137,289,123	100.00%
Límite Máximo de VaR: 2.580%			VaR Promedio: 1.4480%		
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.					

