

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

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
EFFECTIVO Y EQUIVALENTES DE EFFECTIVO					
	Chequera en Euros			\$95,318,691	99.67 %
CHE	40-012	2742284	N/A	\$95,318,691	99.67 %
	Chequera en Pesos			\$15,000	0.02 %
CHM	40-012	2742136	N/A	\$15,000	0.02 %
	TOTAL DE EFFECTIVO Y EQUIVALENTES DE EFFECTIVO			\$95,333,691	99.69 %
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADOR					
	Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)			\$297,719	0.31 %
IQ	BPAG91	270909	AAA(mex)	\$297,719	0.31 %
	TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE			\$297,719	0.31 %
	TOTAL DE CARTERA:			\$95,631,410	100.00%
Límite Máximo de VaR: 2.580%			VaR Promedio: 1.1901%		
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.					

