

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

NTEPZO4					
Fondo Banorte 42, S.A. de C.V. Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda					
Categoría: Corto Plazo					
Calificación: AAAf/S1					
T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
EFFECTIVO Y EQUIVALENTES DE EFFECTIVO					
	Chequera en Pesos			\$3,450,395,470	99.90 %
CHM	040072	2905082	N/A	\$3,450,395,470	99.90 %
	TOTAL DE EFFECTIVO Y EQUIVALENTES DE EFFECTIVO			\$3,450,395,470	99.90 %
OPERACIONES DE REPORTO					
REPORTADOR					
	Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LF			\$3,281,210	0.10 %
LF	BONDESF	270318	AAA(mex)	\$3,281,210	0.10 %
	TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTO			\$3,281,210	0.10 %
	TOTAL DE CARTERA:			\$3,453,676,680	100.00%
Límite Máximo de VaR: 0.040%			VaR Promedio: 0.0000%		
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.					
El Fondo no realizará estrategias temporales de Inversión.					
<i>De acuerdo al objetivo de inversión del Fondo, actualmente se encuentra en Periodo de Inversión (del jueves 14 de marzo de 2024 al jueves 13 de junio de 2024)</i>					

