

Composición de la Cartera de Inversión al 27 de febrero de 2026.

NTEPZO4					
Fondo Banorte 42, 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
INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS					
INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES					
Deuda Bancaria					
Pagaré con Rendimiento Liquidable al Vencimiento					
I	NAFIN	26144	F1+ (mex)	\$4,101,841,398	99.57%
Total Deuda Bancaria				\$4,101,841,398	99.57%
TOTAL DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES				\$4,101,841,398	99.57%
TOTAL DE INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS				\$4,101,841,398	99.57%
NO CLASIFICADOS					
NO CLASIFICADOS					
EFFECTIVO Y EQUIVALENTES DE EFFECTIVO					
Chequera en Pesos					
CHM	040072	2905082	N/A	\$0	0.00%
TOTAL DE NO CLASIFICADOS				\$0	0.00%
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADOR					
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)					
IQ	BPAG91	280511	AAA(mex)	\$17,638,860	0.43%
TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE				\$17,638,860	0.43%
TOTAL CARTERA:				\$4,119,480,258	100.00%
Límite Máximo de VaR: 0.040%			VaR Promedio: 0.0096%		
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.					
De acuerdo al objetivo de inversión del Fondo, actualmente se encuentra en Periodo de Inversión (del Jueves 08 de Enero de 2026 al jueves 9 de Abril de 2026)					

