

Composición de la Cartera de Inversión al 29 de diciembre de 2023.

NTESEL					
Fondo Banorte 22, S.A. de C.V. Fondo de Inversión de Renta Variable					
Categoría: Especializado en Acciones					
T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
EFFECTIVO Y EQUIVALENTES DE EFFECTIVO					
Chequera en Pesos				\$1	0.00 %
CHM	040072	7838671	N/A	\$1	0.00 %
TOTAL DE EFFECTIVO Y EQUIVALENTES DE EFFECTIVO				\$1	0.00 %
INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS					
INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES					
Instrumentos financieros de capital					
Acciones Industriales, Comerciales y de Servicios				\$1,056,257,267	98.29 %
1	GFNORTE	O	Alta	\$139,851,928	13.01 %
1	AMX	B	Alta	\$132,530,800	12.33 %
1	GMEXICO	B	Alta	\$94,716,449	8.81 %
1	FEMSA	UBD	Alta	\$85,261,800	7.93 %
1	BIMBO	A	Alta	\$80,363,250	7.48 %
1	CEMEX	CPO	Alta	\$72,448,812	6.74 %
1	LAB	B	Alta	\$63,790,800	5.94 %
1	NEMAK	A	Media	\$59,775,804	5.56 %
1	VOLAR	A	Alta	\$55,600,016	5.17 %
1	GENTERA	*	Alta	\$54,775,208	5.10 %
1	TLEVISA	CPO	Alta	\$52,731,000	4.91 %
1	ASUR	B	Alta	\$47,258,700	4.40 %
1	BOLSA	A	Alta	\$45,857,700	4.27 %
1	CHDRAUI	B	Alta	\$35,903,000	3.34 %
1	ALPEK	A	Media	\$35,392,000	3.29 %
Total instrumentos financieros de capital				\$1,056,257,267	98.29 %
TOTAL DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES				\$1,056,257,267	98.29 %
TOTAL DE INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS				\$1,056,257,267	98.29 %
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADOR					
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Semestral)				\$18,350,581	1.71 %
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	\$18,350,581	1.71 %
TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE				\$18,350,581	1.71 %
TOTAL DE CARTERA:				\$1,074,607,849	100.00%
Límite Máximo de VaR: 3.400%				VaR Promedio: 2.3235%	
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.					

