

Composición de la Cartera de Inversión al 27 de marzo de 2024.

NTEDLS						
Fondo Banorte 18, 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 Dólares				\$3,817,233,988	99.69 %	
CHD	040072	0003357	N/A	\$3,715,382,053	97.03 %	
CHD	37-006	0550060	N/A	\$98,441,374	2.57 %	
CHD	40-110	4278637	N/A	\$3,410,561	0.09 %	
TOTAL DE EFFECTIVO Y EQUIVALENTES DE EFFECTIVO				\$3,817,233,988	99.69 %	
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADOR						
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)				\$11,881,712	0.31 %	
IQ	BPAG91	250102	AAA(mex)	\$11,881,712	0.31 %	
TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTO				\$11,881,712	0.31 %	
TOTAL DE CARTERA:				\$3,829,115,700	100.00%	
Límite Máximo de VaR: 2.350%			VaR Promedio: 1.3612%			
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.						

