

Composición de la Cartera de Inversión al 31 de mayo 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				\$3,603,288,078	99.77 %	
CHD	040072	0003357	N/A	\$3,498,015,246	96.86 %	
CHD	37-006	0550060	N/A	\$101,758,496	2.82 %	
CHD	40-110	4278637	N/A	\$3,514,336	0.10 %	
TOTAL DE EFFECTIVO Y EQUIVALENTES DE EFFECTIVO				\$3,603,288,078	99.77 %	
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADOR						
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)				\$8,146,682	0.23 %	
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	\$8,146,682	0.23 %	
TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE				\$8,146,682	0.23 %	
TOTAL DE CARTERA:				\$3,611,434,760	100.00%	
Límite Máximo de VaR: 2.350%			VaR Promedio: 1.3308%			
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.						

