

Composición de la Cartera de Inversión al 30 de junio de 2022.

NTEPZO2					
Fondo Banorte 36, 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
INVERSIONES EN VALORES					
TÍTULOS PARA NEGOCIAR					
Deuda Bancaria					
	Pagaré con Rendimiento Liquidable al Vencimiento			\$7,207,092,702	99.75%
I	BANOBRA	22334	F1+ (mex)	\$5,041,890,162	69.78%
I	BACMEXT	22334	F1+ (mex)	\$2,165,202,540	29.97%
	Total Deuda Bancaria			\$7,207,092,702	99.75%
TOTAL DE TÍTULOS PARA NEGOCIAR				\$7,207,092,702	99.75%
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES				\$7,207,092,702	99.75%
OPERACIONES DE REPORTO					
REPORTADOR					
	Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)			\$18,270,348	0.25%
IQ	BPAG91	260903	AAA(mex)	\$9,135,174	0.13%
	TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTO			\$9,135,174	0.13%
IQ	BPAG91	260903	AAA(mex)	\$9,135,174	0.13%
	TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTO			\$18,270,348	0.25%
TOTAL CARTERA:				\$7,225,363,050	100.00%
Limite 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 500 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 19 de mayo de 2022 al jueves 18 de agosto de 2022)					

