

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

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	
DISPONIBILIDADES						
Chequera en Dólares				\$5,600,012,601	99.61 %	
CHD	40-110	4278637	N/A	\$4,285,816,319	76.23 %	
CHD	040072	0003357	N/A	\$1,203,299,947	21.40 %	
CHD	37-006	0550060	N/A	\$110,896,335	1.97 %	
TOTAL DE DISPONIBILIDADES				\$5,600,012,601	99.61 %	
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADOR						
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)				\$22,071,603	0.39 %	
IQ	BPAG91	260903	AAA(mex)	\$22,071,603	0.39 %	
TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE				\$22,071,603	0.39 %	
TOTAL DE CARTERA:				\$5,622,084,204	100.00%	
Límite Máximo de VaR: 2.350%				VaR Promedio: 1.3530%		
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.						

