

Composición de la Cartera de Inversión al 13 de junio 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 | | | | \$3,842,351,002 | 99.77 % | |
| CHD | 040072 | 0003357 | N/A | \$3,727,563,987 | 96.79 % | |
| CHD | 37-006 | 0550060 | N/A | \$110,957,092 | 2.88 % | |
| CHD | 40-110 | 4278637 | N/A | \$3,829,923 | 0.10 % | |
| TOTAL DE EFFECTIVO Y EQUIVALENTES DE EFFECTIVO | | | | \$3,842,351,002 | 99.77 % | |
| OPERACIONES DE REPORTE | | | | | | |
| REPORTADOR | | | | | | |
| Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral) | | | | \$8,753,193 | 0.23 % | |
| IQ | BPAG91 | 270909 | AAA(mex) | \$8,753,193 | 0.23 % | |
| TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE | | | | \$8,753,193 | 0.23 % | |
| TOTAL DE CARTERA: | | | | \$3,851,104,195 | 100.00% | |
| Límite Máximo de VaR: 2.350% | | | VaR Promedio: 1.2480% | | | |
| 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. | | | | | | |

