

Composición de la Cartera de Inversión al 11 de abril de 2024.

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 INSTRUMENTOS FINANCIEROS					
INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES					
Deuda Bancaria					
	Pagaré con Rendimiento Liquidable al Vencimiento			\$14,252,746,617	99.76 %
I	BANOBRA	24284	F1+ (mex)	\$14,252,746,617	99.76 %
	Total Deuda Bancaria			\$14,252,746,617	99.76 %
TOTAL DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES				\$14,252,746,617	99.76 %
TOTAL DE INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS				\$14,252,746,617	99.76 %
OPERACIONES DE REPORTO					
REPORTADOR					
	Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LF			\$33,819,579	0.24 %
LF	BONDESF	271014	AAA(mex)	\$33,819,579	0.24 %
TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTO				\$33,819,579	0.24 %
TOTAL DE CARTERA:				\$14,286,566,196	100.00%
Límite 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 501 observaciones.					
El Fondo no realizará estrategias temporales de Inversión.					
<i>De acuerdo al objetivo de inversión del Fondo, actualmente se encuentra en Periodo de Inversión (del jueves 11 de abril de 2024 al jueves 11 de julio de 2024)</i>					

