

**Composición de la Cartera de Inversión al 20 de junio de 2024.**

<b>NTEPZO2</b>					
Fondo Banorte 36, S.A. de C.V. Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda					
Categoría: Corto Plazo					
Calificación: AA Af/S1					
T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
<b>EFFECTIVO Y EQUIVALENTES DE EFFECTIVO</b>					
	<b>Chequera en Pesos</b>			<b>\$2,178,301</b>	<b>0.01 %</b>
CHM	040072	2892511	N/A	\$2,178,301	0.01 %
	<b>TOTAL DE EFFECTIVO Y EQUIVALENTES DE EFFECTIVO</b>			<b>\$2,178,301</b>	<b>0.01 %</b>
<b>INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS</b>					
<b>INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES</b>					
<b>Deuda Bancaria</b>					
	<b>Pagaré con Rendimiento Liquidable al Vencimiento</b>			<b>\$14,561,495,546</b>	<b>99.99 %</b>
I	BANOBRA	24284	F1+ (mex)	\$14,561,495,546	99.99 %
	<b>Total Deuda Bancaria</b>			<b>\$14,561,495,546</b>	<b>99.99 %</b>
	<b>TOTAL DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES</b>			<b>\$14,561,495,546</b>	<b>99.99 %</b>
	<b>TOTAL DE INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS</b>			<b>\$14,561,495,546</b>	<b>99.99 %</b>
	<b>TOTAL DE CARTERA:</b>			<b>\$14,563,673,847</b>	<b>100.00%</b>
<b>Límite Máximo de VaR: 0.040%</b>			<b>VaR Promedio: 0.0079%</b>		
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.					
<b>El Fondo no realizará estrategias temporales de Inversión.</b>					
<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>					

