

Composición de la Cartera de Inversión al 29 de mayo de 2026.

NTEPZO2						
Fondo Banorte 36, S.A. de C.V. Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda						
Categoría: Corto Plazo						
Calificación: AAAf/S1 (mex)						
T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN	
EFFECTIVO Y EQUIVALENTES DE EFFECTIVO						
Chequera en Pesos						
CHM	040072	2892511	N/A	\$1	\$1	0.00%
TOTAL DE EFFECTIVO Y EQUIVALENTES DE EFFECTIVO				\$1	\$1	0.00%
INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS						
INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES						
Deuda Bancaria						
Pagaré con Rendimiento Liquidable al Vencimiento						
I	BACMEXT	26221	F1+ (mex)	\$10,005,483,305	\$10,005,483,305	87.41%
Total Deuda Bancaria				\$10,005,483,305	\$10,005,483,305	87.41%
TOTAL DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES				\$10,005,483,305	\$10,005,483,305	87.41%
TOTAL DE INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS				\$10,005,483,305	\$10,005,483,305	87.41%
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADOR						
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)						
IQ	BPAG91	280511	AAA(mex)	\$440,213,944	\$440,213,944	3.85%
Bonos del Gobierno Federal (Tasa Fija)						
M	BONOS	300228	AAA(mex)	\$1,000,548,257	\$1,000,548,257	8.74%
TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTO				\$1,440,762,201	\$1,440,762,201	12.59%
TOTAL CARTERA:				\$11,446,245,507	\$11,446,245,507	100.00%
Límite Máximo de VaR: 0.040% VaR Promedio: 0.0004%						
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.						

