

Composición de la Cartera de Inversión al 18 de junio 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 | 26354 | F1+ (mex) | \$11,484,251,855 | \$11,484,251,855 | 99.53% |
| Total Deuda Bancaria | | | | \$11,484,251,855 | \$11,484,251,855 | 99.53% |
| TOTAL DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES | | | | \$11,484,251,855 | \$11,484,251,855 | 99.53% |
| TOTAL DE INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS | | | | \$11,484,251,855 | \$11,484,251,855 | 99.53% |
| OPERACIONES DE REPORTO | | | | | | |
| REPORTADOR | | | | | | |
| Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LF | | | | | | |
| LF | BONDEF | 291101 | AAA(mex) | \$53,954,607 | \$53,954,607 | 0.47% |
| TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTO | | | | \$53,954,607 | \$53,954,607 | 0.47% |
| TOTAL CARTERA: | | | | \$11,538,206,463 | \$11,538,206,463 | 100.00% |
| Limite Máximo de VaR: 0.040% | | | VaR Promedio: 0.0147% | | | |
| 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. | | | | | | |
| De acuerdo al objetivo de inversión del Fondo, actualmente se encuentra en Periodo de Inversión (del jueves 04 de Junio de 2026 al jueves 03 de Septiembre 2026) | | | | | | |



Signatory of:

