

Composición de la Cartera de Inversión al 31 de mayo de 2024.

NTELP					
Fondo Banorte 13, S.A de C.V. Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda					
Categoría: Largo Plazo					
Calificación: AAAf/S5(mex)					
T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
EFFECTIVO Y EQUIVALENTES DE EFFECTIVO					
	Chequera en Pesos			\$1	0.00 %
CHM	040072	7143683	N/A	\$1	0.00 %
	TOTAL DE EFFECTIVO Y EQUIVALENTES DE EFFECTIVO			\$1	0.00 %
INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS					
INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES					
Deuda Gubernamental					
	Bonos del Gobierno Federal (Tasa Fija)			\$537,225,873	77.09 %
M	BONOS	270603	AAA(mex)	\$188,063,862	26.99 %
M	BONOS	290301	AAA(mex)	\$82,635,565	11.86 %
M	BONOS	310529	AAA(mex)	\$72,863,014	10.46 %
M	BONOS	290531	AAA(mex)	\$58,848,377	8.44 %
M	BONOS	330526	AAA(mex)	\$49,632,525	7.12 %
M	BONOS	421113	AAA(mex)	\$40,448,279	5.80 %
M	BONOS	381118	AAA(mex)	\$21,670,682	3.11 %
M	BONOS	341123	AAA(mex)	\$14,528,192	2.08 %
M	BONOS	361120	AAA(mex)	\$8,535,377	1.22 %
	Certificados de la Tesorería de la Federación			\$79,946,018	11.47 %
BI	CETES	241128	AAA(mex)	\$47,371,700	6.80 %
BI	CETES	250515	AAA(mex)	\$18,122,494	2.60 %
BI	CETES	241003	AAA(mex)	\$14,451,824	2.07 %
	Total Deuda Gubernamental			\$617,171,891	88.56 %
Otros Títulos de Deuda					
	Certificados Bursátiles Respaldados por Hipotecas			\$1,487,128	0.21 %
97	METROCB	06U	CC (mex)	\$1,487,128	0.21 %
	Total Otros Títulos de Deuda			\$1,487,128	0.21 %
	TOTAL DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES			\$618,659,019	88.78 %
	TOTAL DE INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS			\$618,659,019	88.78 %
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADOR					
	Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LF			\$39,111,162	5.61 %
LF	BONDEF	290322	AAA(mex)	\$39,111,162	5.61 %
	Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)			\$39,111,086	5.61 %
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	\$39,111,086	5.61 %
	TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE			\$78,222,248	11.22 %
	TOTAL DE CARTERA:			\$696,881,268	100.00%
Límite Máximo de VaR: 1.010%			VaR Promedio: 0.2901%		
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.					



TV	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
Valores Respaldados por Activos.					
97	METROCB	06U	CC (mex)	\$1,487,128	0.21 %
Total:				\$1,487,128	0.21%

"El riesgo en los instrumentos financieros derivados, certificados bursátiles fiduciarios y valores estructurados o respaldados por activos (en caso de tenerlos en el fondo) consiste en movimientos adversos en los factores de riesgo que afecten instrumento adquirido. El riesgo se considera alto debido a la existencia de factores de riesgo implícitos como movimiento de tasas de interés, tipos de cambio o inflación, etc"

