

Composición de la Cartera de Inversión al 27 de marzo de 2024.

NTETR					
Fondo Banorte 15, S.A. de C.V. Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda					
Categoría: Largo Plazo Gubernamental					
Calificación: AAAf/S5(mex)					
T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS					
INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES					
Deuda Gubernamental					
Certificados de la Tesorería de la Federación				\$41,304,219	8.93 %
BI	CETES	241128	AAA(mex)	\$12,100,661	2.62 %
BI	CETES	250206	AAA(mex)	\$9,130,589	1.97 %
BI	CETES	250515	AAA(mex)	\$8,936,109	1.93 %
BI	CETES	241003	AAA(mex)	\$6,619,681	1.43 %
BI	CETES	250320	AAA(mex)	\$4,517,179	0.98 %
Udibonos				\$352,735,970	76.25 %
S	UDIBONO	311127	AAA(mex)	\$177,820,973	38.44 %
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	\$174,914,997	37.81 %
Total Deuda Gubernamental				\$394,040,189	85.18 %
TOTAL DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES				\$394,040,189	85.18 %
TOTAL DE INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS				\$394,040,189	85.18 %
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADOR					
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)				\$68,577,899	14.82 %
IQ	BPAG91	250102	AAA(mex)	\$68,577,899	14.82 %
TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE				\$68,577,899	14.82 %
TOTAL DE CARTERA:				\$462,618,088	100.00%
Límite Máximo de VaR: 0.680%			VaR Promedio: 0.2920%		
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.					

