

**Composición de la Cartera de Inversión al 30 de junio de 2022.**

| <b>NTETR</b>   |         |        |                              |                          |                    |
|--|---------|--------|------------------------------|--------------------------|--------------------|
| 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<br>TOTAL | %<br>PARTICIPACIÓN |
| <b>INVERSIONES EN VALORES</b>  |         |        |                              |                          |                    |
| <b>TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>   |         |        |                              |                          |                    |
| <b>Deuda Gubernamental</b>   |         |        |                              |                          |                    |
| <b>Certificados de la Tesorería de la Federación</b>   |         |        |                              | <b>\$175,410,362</b>     | <b>15.84 %</b>     |
| BI   | CETES   | 230209 | AAA(mex)                     | \$61,457,559             | 5.55 %             |
| BI   | CETES   | 230601 | AAA(mex)                     | \$59,666,380             | 5.39 %             |
| BI   | CETES   | 230309 | AAA(mex)                     | \$32,847,826             | 2.97 %             |
| BI   | CETES   | 221020 | AAA(mex)                     | \$21,438,597             | 1.94 %             |
| <b>Udibonos</b>  |         |        |                              | <b>\$880,848,532</b>     | <b>79.53 %</b>     |
| S  | UDIBONO | 251204 | AAA(mex)                     | \$333,589,793            | 30.12 %            |
| S  | UDIBONO | 281130 | AAA(mex)                     | \$291,413,352            | 26.31 %            |
| S  | UDIBONO | 311127 | AAA(mex)                     | \$109,380,342            | 9.88 %             |
| S  | UDIBONO | 261203 | AAA(mex)                     | \$74,277,727             | 6.71 %             |
| S  | UDIBONO | 231116 | AAA(mex)                     | \$72,187,318             | 6.52 %             |
| <b>Total Deuda Gubernamental</b>   |         |        |                              | <b>\$1,056,258,894</b>   | <b>95.37 %</b>     |
| <b>TOTAL DE TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>  |         |        |                              | <b>\$1,056,258,894</b>   | <b>95.37 %</b>     |
| <b>TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES</b>   |         |        |                              | <b>\$1,056,258,894</b>   | <b>95.37 %</b>     |
| <b>OPERACIONES DE REPORTE</b>  |         |        |                              |                          |                    |
| <b>REPORTADOR</b>  |         |        |                              |                          |                    |
| <b>Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)</b>   |         |        |                              | <b>\$51,308,582</b>      | <b>4.63 %</b>      |
| IQ   | BPAG91  | 260903 | AAA(mex)                     | \$51,308,582             | 4.63 %             |
| <b>TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE</b>   |         |        |                              | <b>\$51,308,582</b>      | <b>4.63 %</b>      |
| <b>TOTAL DE CARTERA:</b>   |         |        |                              | <b>\$1,107,567,476</b>   | <b>100.00%</b>     |
| <b>Límite Máximo de VaR: 0.680%</b>  |         |        | <b>VaR Promedio: 0.3363%</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 500 observaciones. |         |        |                              |                          |                    |
| Actualmente el Fondo no se encuentra en estrategia temporal de inversión.  |         |        |                              |                          |                    |

