

Composición de la Cartera de Inversión al 31 de diciembre de 2021.

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 VALORES					
TÍTULOS PARA NEGOCIAR					
Deuda Gubernamental					
Certificados de la Tesorería de la Federación				\$146,338,304	9.59 %
BI	CETES	220505	AAA(mex)	\$24,501,660	1.61 %
BI	CETES	220630	AAA(mex)	\$24,247,945	1.59 %
BI	CETES	220728	AAA(mex)	\$24,112,700	1.58 %
BI	CETES	220922	AAA(mex)	\$20,974,369	1.38 %
BI	CETES	221006	AAA(mex)	\$20,915,730	1.37 %
BI	CETES	221020	AAA(mex)	\$20,857,316	1.37 %
BI	CETES	220602	AAA(mex)	\$10,728,584	0.70 %
Udibonos				\$1,309,824,963	85.87 %
S	UDIBONO	231116	AAA(mex)	\$576,793,724	37.81 %
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	\$573,218,131	37.58 %
S	UDIBONO	220609	AAA(mex)	\$159,813,108	10.48 %
Total Deuda Gubernamental				\$1,456,163,267	95.47 %
TOTAL DE TÍTULOS PARA NEGOCIAR				\$1,456,163,267	95.47 %
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES				\$1,456,163,267	95.47 %
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADOR					
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)				\$69,172,575	4.53 %
IQ	BPAG91	260507	AAA(mex)	\$69,172,575	4.53 %
TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE				\$69,172,575	4.53 %
TOTAL DE CARTERA:				\$1,525,335,842	100.00%
Límite Máximo de VaR: 0.680%			VaR Promedio: 0.3184%		
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.					

