

Composición de la Cartera de Inversión al 30 de abril 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				\$41,591,509	9.42 %
BI	CETES	241128	AAA(mex)	\$12,195,418	2.76 %
BI	CETES	250206	AAA(mex)	\$9,189,487	2.08 %
BI	CETES	250515	AAA(mex)	\$8,979,330	2.03 %
BI	CETES	241003	AAA(mex)	\$6,678,649	1.51 %
BI	CETES	250320	AAA(mex)	\$4,548,625	1.03 %
Udibonos				\$344,714,645	78.09 %
S	UDIBONO	311127	AAA(mex)	\$173,366,322	39.27 %
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	\$171,348,323	38.82 %
Total Deuda Gubernamental				\$386,306,154	87.51 %
TOTAL DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES				\$386,306,154	87.51 %
TOTAL DE INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS				\$386,306,154	87.51 %
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADOR					
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)				\$55,136,977	12.49 %
IQ	BPAG91	270909	AAA(mex)	\$55,136,977	12.49 %
TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE				\$55,136,977	12.49 %
TOTAL DE CARTERA:				\$441,443,131	100.00%
Límite Máximo de VaR: 0.680%			VaR Promedio: 0.3042%		
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.					

