

Composición de la Cartera de Inversión al 31 de mayo 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				\$41,994,234	9.47 %
BI	CETES	241128	AAA(mex)	\$12,316,642	2.78 %
BI	CETES	250206	AAA(mex)	\$9,280,276	2.09 %
BI	CETES	250515	AAA(mex)	\$9,061,247	2.04 %
BI	CETES	241003	AAA(mex)	\$6,744,184	1.52 %
BI	CETES	250320	AAA(mex)	\$4,591,885	1.04 %
Udibonos				\$342,360,600	77.20 %
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	\$173,418,537	39.11 %
S	UDIBONO	311127	AAA(mex)	\$168,942,063	38.10 %
Total Deuda Gubernamental				\$384,354,834	86.67 %
TOTAL DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES				\$384,354,834	86.67 %
TOTAL DE INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS				\$384,354,834	86.67 %
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADOR					
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)				\$59,089,591	13.33 %
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	\$59,089,591	13.33 %
TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE				\$59,089,591	13.33 %
TOTAL DE CARTERA:				\$443,444,425	100.00%
Límite Máximo de VaR: 0.680%			VaR Promedio: 0.3060%		
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.					

