

Composición de la Cartera de Inversión al 18 de abril de 2024.

NTELP					
Fondo Banorte 13, S.A de C.V. Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda					
Categoría: Largo Plazo					
Calificación: AAAf/S5(mex)					
T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
EFFECTIVO Y EQUIVALENTES DE EFFECTIVO					
	Chequera en Pesos			\$1	0.00 %
CHM	040072	7143683	N/A	\$1	0.00 %
	TOTAL DE EFFECTIVO Y EQUIVALENTES DE EFFECTIVO			\$1	0.00 %
INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS					
INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES					
Deuda Gubernamental					
	Bonos del Gobierno Federal (Tasa Fija)			\$545,590,392	75.84 %
M	BONOS	270603	AAA(mex)	\$185,505,609	25.79 %
M	BONOS	290301	AAA(mex)	\$81,293,106	11.30 %
M	BONOS	310529	AAA(mex)	\$80,643,964	11.21 %
M	BONOS	290531	AAA(mex)	\$57,847,824	8.04 %
M	BONOS	330526	AAA(mex)	\$57,328,679	7.97 %
M	BONOS	421113	AAA(mex)	\$39,354,380	5.47 %
M	BONOS	381118	AAA(mex)	\$21,119,890	2.94 %
M	BONOS	341123	AAA(mex)	\$14,166,798	1.97 %
M	BONOS	361120	AAA(mex)	\$8,330,142	1.16 %
	Certificados de la Tesorería de la Federación			\$78,935,468	10.97 %
BI	CETES	241128	AAA(mex)	\$46,739,945	6.50 %
BI	CETES	250515	AAA(mex)	\$17,938,182	2.49 %
BI	CETES	241003	AAA(mex)	\$14,257,341	1.98 %
	Total Deuda Gubernamental			\$624,525,860	86.82 %
Otros Títulos de Deuda					
	Certificados Bursátiles Respaldados por Hipotecas			\$1,511,068	0.21 %
97	METROCB	06U	CC (mex)	\$1,511,068	0.21 %
	Total Otros Títulos de Deuda			\$1,511,068	0.21 %
	TOTAL DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES			\$626,036,928	87.03 %
	TOTAL DE INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS			\$626,036,928	87.03 %
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADOR					
	Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LF			\$46,656,342	6.49 %
LF	BONDEF	270128	AAA(mex)	\$46,656,342	6.49 %
	Bonos de Protección al Ahorro (Pago Semestral)			\$46,656,321	6.49 %
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	\$46,656,321	6.49 %
	TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE			\$93,312,663	12.97 %
	TOTAL DE CARTERA:			\$719,349,592	100.00%
Límite Máximo de VaR: 1.010% VaR Promedio: 0.2741%					
Valor en Riesgo (VaR) Supuestos y Metodología: Horizonte de tiempo de un día y con nivel de confianza al 95% a dos cosas basada en una simulación histórica no paramétrica de 501 observaciones.					
Actualmente el Fondo no se encuentra en estrategia temporal de inversión.					



TV	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
Valores Respaldados por Activos.					
97	METROCB	06U	CC (mex)	\$1,511,068	0.21 %
Total:				\$1,511,068	0.21%

"El riesgo en los instrumentos financieros derivados, certificados bursátiles fiduciarios y valores estructurados o respaldados por activos (en caso de tenerlos en el fondo) consiste en movimientos adversos en los factores de riesgo que afecten instrumento adquirido. El riesgo se considera alto debido a la existencia de factores de riesgo implícitos como movimiento de tasas de interés, tipos de cambio o inflación, etc"

