

Composición de la Cartera de Inversión al 13 de junio 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				\$110,212	0.02 %
CHM	040072	7143683	N/A	\$110,212	0.02 %
TOTAL DE EFFECTIVO Y EQUIVALENTES DE EFFECTIVO				\$110,212	0.02 %
INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS					
INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES					
Deuda Gubernamental					
Bonos del Gobierno Federal (Tasa Fija)				\$520,980,295	74.87 %
M	BONOS	270603	AAA(mex)	\$179,759,665	25.83 %
M	BONOS	290301	AAA(mex)	\$81,961,606	11.78 %
M	BONOS	310529	AAA(mex)	\$68,897,092	9.90 %
M	BONOS	290531	AAA(mex)	\$55,748,261	8.01 %
M	BONOS	330526	AAA(mex)	\$46,691,971	6.71 %
M	BONOS	421113	AAA(mex)	\$37,681,478	5.42 %
M	BONOS	341123	AAA(mex)	\$22,124,723	3.18 %
M	BONOS	381118	AAA(mex)	\$20,165,695	2.90 %
M	BONOS	361120	AAA(mex)	\$7,949,804	1.14 %
Certificados de la Tesorería de la Federación				\$80,166,871	11.52 %
BI	CETES	241128	AAA(mex)	\$47,522,195	6.83 %
BI	CETES	250515	AAA(mex)	\$18,142,824	2.61 %
BI	CETES	241003	AAA(mex)	\$14,501,852	2.08 %
Total Deuda Gubernamental				\$601,147,166	86.39 %
Otros Títulos de Deuda					
Certificados Bursátiles Respaldados por Hipotecas				\$1,462,625	0.21 %
97	METROCB	06U	CC (mex)	\$1,462,625	0.21 %
Total Otros Títulos de Deuda				\$1,462,625	0.21 %
TOTAL DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES				\$602,609,791	86.60 %
TOTAL DE INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS				\$602,609,791	86.60 %
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADOR					
Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LF				\$46,550,388	6.69 %
LF	BONDEF	270318	AAA(mex)	\$46,550,388	6.69 %
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)				\$46,550,374	6.69 %
IQ	BPAG91	270909	AAA(mex)	\$46,550,374	6.69 %
TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE				\$93,100,762	13.38 %
TOTAL DE CARTERA:				\$695,820,765	100.00%
Límite Máximo de VaR: 1.010%			VaR Promedio: 0.2817%		
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)	\$1,462,625	0.21 %
Total:				\$1,462,625	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"

