

Composición de la Cartera de Inversión al 30 de junio de 2022.

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				\$175,410,362	15.84 %
BI	CETES	230209	AAA(mex)	\$61,457,559	5.55 %
BI	CETES	230601	AAA(mex)	\$59,666,380	5.39 %
BI	CETES	230309	AAA(mex)	\$32,847,826	2.97 %
BI	CETES	221020	AAA(mex)	\$21,438,597	1.94 %
Udibonos				\$880,848,532	79.53 %
S	UDIBONO	251204	AAA(mex)	\$333,589,793	30.12 %
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	\$291,413,352	26.31 %
S	UDIBONO	311127	AAA(mex)	\$109,380,342	9.88 %
S	UDIBONO	261203	AAA(mex)	\$74,277,727	6.71 %
S	UDIBONO	231116	AAA(mex)	\$72,187,318	6.52 %
Total Deuda Gubernamental				\$1,056,258,894	95.37 %
TOTAL DE TÍTULOS PARA NEGOCIAR				\$1,056,258,894	95.37 %
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES				\$1,056,258,894	95.37 %
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADOR					
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)				\$51,308,582	4.63 %
IQ	BPAG91	260903	AAA(mex)	\$51,308,582	4.63 %
TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE				\$51,308,582	4.63 %
TOTAL DE CARTERA:				\$1,107,567,476	100.00%
Límite Máximo de VaR: 0.680%			VaR Promedio: 0.3450%		
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.					

