

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

<b>NTETR</b>					
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
<b>INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS</b>					
<b>INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES</b>					
<b>Deuda Gubernamental</b>					
<b>Certificados de la Tesorería de la Federación</b>				<b>\$41,468,560</b>	<b>9.30 %</b>
BI	CETES	241128	AAA(mex)	\$12,152,386	2.73 %
BI	CETES	250206	AAA(mex)	\$9,158,483	2.05 %
BI	CETES	250515	AAA(mex)	\$8,969,091	2.01 %
BI	CETES	241003	AAA(mex)	\$6,653,426	1.49 %
BI	CETES	250320	AAA(mex)	\$4,535,174	1.02 %
<b>Udibonos</b>				<b>\$340,567,186</b>	<b>76.37 %</b>
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	\$170,664,202	38.27 %
S	UDIBONO	311127	AAA(mex)	\$169,902,984	38.10 %
<b>Total Deuda Gubernamental</b>				<b>\$382,035,746</b>	<b>85.67 %</b>
<b>TOTAL DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES</b>				<b>\$382,035,746</b>	<b>85.67 %</b>
<b>TOTAL DE INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS</b>				<b>\$382,035,746</b>	<b>85.67 %</b>
<b>OPERACIONES DE REPORTE</b>					
<b>REPORTADOR</b>					
<b>Bonos de Protección al Ahorro (Pago Semestral)</b>				<b>\$63,891,582</b>	<b>14.33 %</b>
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	\$63,891,582	14.33 %
<b>TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE</b>				<b>\$63,891,582</b>	<b>14.33 %</b>
<b>TOTAL DE CARTERA:</b>				<b>\$445,927,328</b>	<b>100.00%</b>
<b>Límite Máximo de VaR: 0.680%</b>			<b>VaR Promedio: 0.3215%</b>		
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.					
<b>Actualmente el Fondo no se encuentra en estrategia temporal de inversión.</b>					

