

Composición de la Cartera de Inversión al 23 de septiembre de 2021.

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				\$144,222,445	12.74 %
BI	CETES	220210	AAA(mex)	\$24,517,420	2.17 %
BI	CETES	220505	AAA(mex)	\$24,214,298	2.14 %
BI	CETES	220630	AAA(mex)	\$24,010,520	2.12 %
BI	CETES	220728	AAA(mex)	\$23,894,230	2.11 %
BI	CETES	220331	AAA(mex)	\$20,445,791	1.81 %
BI	CETES	220407	AAA(mex)	\$16,532,809	1.46 %
BI	CETES	220602	AAA(mex)	\$10,607,377	0.94 %
Udibonos				\$950,171,118	83.93 %
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	\$416,462,235	36.79 %
S	UDIBONO	231116	AAA(mex)	\$376,592,538	33.27 %
S	UDIBONO	220609	AAA(mex)	\$157,116,345	13.88 %
Total Deuda Gubernamental				\$1,094,393,563	96.67 %
TOTAL DE TÍTULOS PARA NEGOCIAR				\$1,094,393,563	96.67 %
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES				\$1,094,393,563	96.67 %
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADOR					
Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal				\$37,668,510	3.33 %
LD	BONDESD	220317	AAA(mex)	\$37,668,510	3.33 %
TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE				\$37,668,510	3.33 %
TOTAL DE CARTERA:				\$1,132,062,073	100.00%
Límite Máximo de VaR: 0.680%			VaR Promedio: 0.3230%		
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.					

