

Composición de la Cartera de Inversión al 16 de mayo de 2024.

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 INSTRUMENTOS FINANCIEROS					
INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES					
Deuda Gubernamental					
Certificados de la Tesorería de la Federación				\$41,790,969	9.54 %
BI	CETES	241128	AAA(mex)	\$12,252,699	2.80 %
BI	CETES	250206	AAA(mex)	\$9,234,626	2.11 %
BI	CETES	250515	AAA(mex)	\$9,023,093	2.06 %
BI	CETES	241003	AAA(mex)	\$6,709,851	1.53 %
BI	CETES	250320	AAA(mex)	\$4,570,700	1.04 %
Udibonos				\$344,093,864	78.58 %
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	\$174,136,869	39.77 %
S	UDIBONO	311127	AAA(mex)	\$169,956,995	38.81 %
Total Deuda Gubernamental				\$385,884,833	88.12 %
TOTAL DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES				\$385,884,833	88.12 %
TOTAL DE INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS				\$385,884,833	88.12 %
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADOR					
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Semestral)				\$52,002,108	11.88 %
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	\$52,002,108	11.88 %
TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE				\$52,002,108	11.88 %
TOTAL DE CARTERA:				\$437,886,941	100.00%
Límite Máximo de VaR: 0.680%			VaR Promedio: 0.2860%		
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.					
Actualmente el Fondo no se encuentra en estrategia temporal de inversión.					

