

**Composición de la Cartera de Inversión al 13 de junio 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>\$42,114,766</b>	<b>9.78 %</b>
BI	CETES	241128	AAA(mex)	\$12,355,771	2.87 %
BI	CETES	250206	AAA(mex)	\$9,313,258	2.16 %
BI	CETES	250515	AAA(mex)	\$9,071,412	2.11 %
BI	CETES	241003	AAA(mex)	\$6,767,531	1.57 %
BI	CETES	250320	AAA(mex)	\$4,606,794	1.07 %
<b>Udibonos</b>				<b>\$329,593,506</b>	<b>76.54 %</b>
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	\$167,809,142	38.97 %
S	UDIBONO	311127	AAA(mex)	\$161,784,364	37.57 %
<b>Total Deuda Gubernamental</b>				<b>\$371,708,272</b>	<b>86.32 %</b>
<b>TOTAL DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES</b>				<b>\$371,708,272</b>	<b>86.32 %</b>
<b>TOTAL DE INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS</b>				<b>\$371,708,272</b>	<b>86.32 %</b>
<b>OPERACIONES DE REPORTE</b>					
<b>REPORTADOR</b>					
<b>Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)</b>				<b>\$58,909,583</b>	<b>13.68 %</b>
IQ	BPAG91	270909	AAA(mex)	\$58,909,583	13.68 %
<b>TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE</b>				<b>\$58,909,583</b>	<b>13.68 %</b>
<b>TOTAL DE CARTERA:</b>				<b>\$430,617,855</b>	<b>100.00%</b>
<b>Límite Máximo de VaR: 0.680%</b>			<b>VaR Promedio: 0.3339%</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>					

