

Composición de la Cartera de Inversión al 28 de mayo de 2026.

NTETR					
Fondo Banorte 15, S.A. de C.V. Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda					
Categoría: Largo Plazo Gubernamental					
Calificación: AA Af/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				\$287,944,637	21.02 %
BI	CETES	270121	AAA(mex)	\$25,841,749	1.89 %
BI	CETES	270513	AAA(mex)	\$23,399,760	1.71 %
BI	CETES	270708	AAA(mex)	\$23,120,308	1.69 %
BI	CETES	270318	AAA(mex)	\$19,885,049	1.45 %
BI	CETES	271028	AAA(mex)	\$19,851,256	1.45 %
BI	CETES	270902	AAA(mex)	\$18,265,106	1.33 %
BI	CETES	261001	AAA(mex)	\$16,618,025	1.21 %
BI	CETES	271223	AAA(mex)	\$15,140,278	1.10 %
BI	CETES	280217	AAA(mex)	\$14,068,662	1.03 %
BI	CETES	280412	AAA(mex)	\$13,012,275	0.95 %
BI	CETES	260806	AAA(mex)	\$11,449,165	0.84 %
BI	CETES	260611	AAA(mex)	\$10,151,393	0.74 %
BI	CETES	270107	AAA(mex)	\$9,597,036	0.70 %
BI	CETES	270204	AAA(mex)	\$9,545,455	0.70 %
BI	CETES	261126	AAA(mex)	\$9,478,383	0.69 %
BI	CETES	270401	AAA(mex)	\$8,501,214	0.62 %
BI	CETES	261112	AAA(mex)	\$6,788,547	0.50 %
BI	CETES	260625	AAA(mex)	\$4,975,706	0.36 %
BI	CETES	270304	AAA(mex)	\$4,748,643	0.35 %
BI	CETES	270429	AAA(mex)	\$4,697,363	0.34 %
BI	CETES	260723	AAA(mex)	\$3,960,372	0.29 %
BI	CETES	260820	AAA(mex)	\$3,940,493	0.29 %
BI	CETES	260917	AAA(mex)	\$3,920,248	0.29 %
BI	CETES	261015	AAA(mex)	\$3,901,174	0.28 %
BI	CETES	261210	AAA(mex)	\$3,086,977	0.23 %
Udibonos				\$963,925,389	70.35 %
S	UDIBONO	290830	AAA(mex)	\$478,107,728	34.89 %
S	UDIBONO	311127	AAA(mex)	\$178,338,732	13.02 %
S	UDIBONO	351122	AAA(mex)	\$173,513,004	12.66 %
S	UDIBONO	340824	AAA(mex)	\$133,833,147	9.77 %
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	\$132,778	0.01 %
Total Deuda Gubernamental				\$1,251,870,026	91.37 %
TOTAL DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES				\$1,251,870,026	91.37 %
TOTAL DE INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS				\$1,251,870,026	91.37 %
OPERACIONES DE REPORTO					
REPORTADOR					
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)				\$118,300,288	8.63 %
IQ	BPAG91	300912	AAA(mex)	\$118,300,288	8.63 %
TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTO				\$118,300,288	8.63 %



T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
TOTAL DE CARTERA:				\$1,370,170,314	100.00%
Límite Máximo de VaR: 0.680%		VaR Promedio: 0.3736%			
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.					

