

Composición de la Cartera de Inversión al 27 de marzo de 2024.

NTELP					
Fondo Banorte 13, S.A de C.V. Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda					
Categoría: Largo Plazo					
Calificación: AAAf/S5(mex)					
T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
EFFECTIVO Y EQUIVALENTES DE EFFECTIVO					
	Chequera en Pesos			\$1	0.00 %
CHM	040072	7143683	N/A	\$1	0.00 %
	TOTAL DE EFFECTIVO Y EQUIVALENTES DE EFFECTIVO			\$1	0.00 %
INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS					
INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES					
Deuda Gubernamental					
	Bonos del Gobierno Federal (Tasa Fija)			\$579,427,417	74.71 %
M	BONOS	270603	AAA(mex)	\$188,415,093	24.29 %
M	BONOS	310529	AAA(mex)	\$92,729,811	11.96 %
M	BONOS	290301	AAA(mex)	\$83,347,726	10.75 %
M	BONOS	330526	AAA(mex)	\$68,781,380	8.87 %
M	BONOS	290531	AAA(mex)	\$59,343,795	7.65 %
M	BONOS	421113	AAA(mex)	\$41,260,069	5.32 %
M	BONOS	381118	AAA(mex)	\$22,089,854	2.85 %
M	BONOS	341123	AAA(mex)	\$14,758,917	1.90 %
M	BONOS	361120	AAA(mex)	\$8,700,772	1.12 %
	Certificados de la Tesorería de la Federación			\$78,598,254	10.13 %
BI	CETES	241128	AAA(mex)	\$46,541,005	6.00 %
BI	CETES	250515	AAA(mex)	\$17,872,218	2.30 %
BI	CETES	241003	AAA(mex)	\$14,185,031	1.83 %
	Total Deuda Gubernamental			\$658,025,671	84.85 %
Otros Títulos de Deuda					
	Certificados Bursátiles Respaldados por Hipotecas			\$1,560,299	0.20 %
97	METROCB	06U	CC (mex)	\$1,560,299	0.20 %
	Total Otros Títulos de Deuda			\$1,560,299	0.20 %
	TOTAL DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES			\$659,585,970	85.05 %
	TOTAL DE INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS			\$659,585,970	85.05 %
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADOR					
	Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LF			\$57,976,347	7.48 %
LF	BONDESF	270318	AAA(mex)	\$57,976,347	7.48 %
	Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)			\$57,976,260	7.48 %
IQ	BPAG91	250102	AAA(mex)	\$57,976,260	7.48 %
	TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE			\$115,952,607	14.95 %
	TOTAL DE CARTERA:			\$775,538,578	100.00%
Límite Máximo de VaR: 1.010%			VaR Promedio: 0.2877%		
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.					



TV	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
Valores Respaldados por Activos.					
97	METROCB	06U	CC (mex)	\$1,560,299	0.20 %
Total:				\$1,560,299	0.20%

"El riesgo en los instrumentos financieros derivados, certificados bursátiles fiduciarios y valores estructurados o respaldados por activos (en caso de tenerlos en el fondo) consiste en movimientos adversos en los factores de riesgo que afecten instrumento adquirido. El riesgo se considera alto debido a la existencia de factores de riesgo implícitos como movimiento de tasas de interés, tipos de cambio o inflación, etc"

