

Composición de la Cartera de Inversión al 25 de abril 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				\$41,532,647	9.39 %
BI	CETES	241128	AAA(mex)	\$12,173,880	2.75 %
BI	CETES	250206	AAA(mex)	\$9,174,223	2.07 %
BI	CETES	250515	AAA(mex)	\$8,976,072	2.03 %
BI	CETES	241003	AAA(mex)	\$6,666,675	1.51 %
BI	CETES	250320	AAA(mex)	\$4,541,797	1.03 %
Udibonos				\$343,980,507	77.74 %
S	UDIBONO	311127	AAA(mex)	\$172,575,825	39.00 %
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	\$171,404,682	38.74 %
Total Deuda Gubernamental				\$385,513,154	87.13 %
TOTAL DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES				\$385,513,154	87.13 %
TOTAL DE INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS				\$385,513,154	87.13 %
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADOR					
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Semestral)				\$56,947,881	12.87 %
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	\$56,947,881	12.87 %
TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE				\$56,947,881	12.87 %
TOTAL DE CARTERA:				\$442,461,035	100.00%
Límite Máximo de VaR: 0.680%			VaR Promedio: 0.3094%		
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.					

