

Composición de la Cartera de Inversión al 28 de junio 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				\$42,320,479	10.14 %
BI	CETES	241128	AAA(mex)	\$12,421,889	2.98 %
BI	CETES	250206	AAA(mex)	\$9,359,338	2.24 %
BI	CETES	250515	AAA(mex)	\$9,114,159	2.18 %
BI	CETES	241003	AAA(mex)	\$6,801,968	1.63 %
BI	CETES	250320	AAA(mex)	\$4,623,125	1.11 %
Udibonos				\$320,748,005	76.83 %
S	UDIBONO	311127	AAA(mex)	\$160,879,282	38.54 %
S	UDIBONO	281130	AAA(mex)	\$159,868,723	38.30 %
Total Deuda Gubernamental				\$363,068,484	86.97 %
TOTAL DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES				\$363,068,484	86.97 %
TOTAL DE INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS				\$363,068,484	86.97 %
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADOR					
Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LF				\$49,380,391	11.83 %
LF	BONDESF	251204	AAA(mex)	\$49,380,391	11.83 %
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)				\$5,007,169	1.20 %
IQ	BPAG91	270909	AAA(mex)	\$5,007,169	1.20 %
TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE				\$54,387,560	13.03 %
TOTAL DE CARTERA:				\$417,456,044	100.00%
Límite Máximo de VaR: 0.680%			VaR Promedio: 0.3422%		
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.					

