

Composición de la Cartera de Inversión al 18 de julio 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 | | | | \$42,537,795 | 9.97 % |
| BI | CETES | 241128 | AAA(mex) | \$12,486,306 | 2.93 % |
| BI | CETES | 250206 | AAA(mex) | \$9,406,232 | 2.20 % |
| BI | CETES | 250515 | AAA(mex) | \$9,160,111 | 2.15 % |
| BI | CETES | 241003 | AAA(mex) | \$6,839,022 | 1.60 % |
| BI | CETES | 250320 | AAA(mex) | \$4,646,124 | 1.09 % |
| Udibonos | | | | \$310,633,363 | 72.80 % |
| S | UDIBONO | 281130 | AAA(mex) | \$157,124,422 | 36.82 % |
| S | UDIBONO | 311127 | AAA(mex) | \$153,508,941 | 35.97 % |
| Total Deuda Gubernamental | | | | \$353,171,158 | 82.77 % |
| TOTAL DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES | | | | \$353,171,158 | 82.77 % |
| TOTAL DE INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS | | | | \$353,171,158 | 82.77 % |
| OPERACIONES DE REPORTE | | | | | |
| REPORTADOR | | | | | |
| Bonos de Protección al Ahorro (Pago Semestral) | | | | \$73,542,106 | 17.23 % |
| IS | BPA182 | 260219 | AAA(mex) | \$73,542,106 | 17.23 % |
| TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE | | | | \$73,542,106 | 17.23 % |
| TOTAL DE CARTERA: | | | | \$426,713,264 | 100.00% |
| Límite Máximo de VaR: 0.680% | | | VaR Promedio: 0.3294% | | |
| 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. | | | | | |

