

Composición de la Cartera de Inversión al 30 de junio de 2022.

NTERTD					
Fondo Banorte 31, S.A. de C.V. Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda					
Categoría: Discrecional					
Calificación: AAAf/S4(mex)					
T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
INVERSIONES EN VALORES					
TÍTULOS PARA NEGOCIAR					
Deuda Gubernamental					
Bonos del Gobierno Federal (Tasa Fija)				\$27,367,709	12.57 %
M	BONOS	530731	AAA(mex)	\$27,367,709	12.57 %
Certificados de la Tesorería de la Federación				\$27,391,649	12.58 %
BI	CETES	230629	AAA(mex)	\$18,212,206	8.37 %
BI	CETES	230601	AAA(mex)	\$9,179,443	4.22 %
Udibonos				\$30,264,068	13.90 %
S	UDIBONO	501103	AAA(mex)	\$19,524,944	8.97 %
S	UDIBONO	231116	AAA(mex)	\$10,739,124	4.93 %
Total Deuda Gubernamental				\$85,023,426	39.05 %
Deuda Bancaria					
Pagaré con Rendimiento Liquidable al Vencimiento				\$15,003,262	6.89 %
I	BACMEXT	22265	F1+ (mex)	\$15,003,262	6.89 %
Total Deuda Bancaria				\$15,003,262	6.89 %
Otros Títulos de Deuda					
Certificados Bursátiles Corporativos				\$14,050,207	6.45 %
91	ARRENCB	21	mxAAA	\$5,134,422	2.36 %
91	TIPMXCB	20-2	AAA (mex)	\$5,034,318	2.31 %
91	CRELCB	19	HR AA+	\$3,881,467	1.78 %
Total Otros Títulos de Deuda				\$14,050,207	6.45 %
TOTAL DE TÍTULOS PARA NEGOCIAR				\$114,076,895	52.40 %
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES				\$114,076,895	52.40 %
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADOR					
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)				\$103,635,072	47.60 %
IQ	BPAG91	260903	AAA(mex)	\$103,635,072	47.60 %
TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE				\$103,635,072	47.60 %
TOTAL DE CARTERA:				\$217,711,967	100.00%
Límite Máximo de VaR: 2.300%			VaR Promedio: 0.2358%		
Valor en Riesgo (VaR) Supuestos y Metodología: Horizonte de tiempo de un día y con nivel de confianza al 95% a dos cosas basada en una simulación histórica no paramétrica de 500 observaciones.					
El Fondo no realizará estrategias temporales de Inversión.					



TV	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
Valores Respaldados por Activos.					
91	ARRENCB	21	mxAAA	\$5,134,422	2.36 %
91	CRELCB	19	HR AA+	\$3,881,467	1.78 %
91	TIPMXCB	20-2	AAA (mex)	\$5,034,318	2.31 %
Total:				\$14,050,207	6.45%

"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"

