

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

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
EFFECTIVO Y EQUIVALENTES DE EFFECTIVO					
	Chequera en Pesos			\$1	0.00 %
CHM	040072	7147252	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)			\$128,937,402	40.82 %
M	BONOS	421113	AAA(mex)	\$35,114,952	11.12 %
M	BONOS	310529	AAA(mex)	\$28,386,677	8.99 %
M	BONOS	330526	AAA(mex)	\$27,512,552	8.71 %
M	BONOS	381118	AAA(mex)	\$19,208,568	6.08 %
M	BONOS	290531	AAA(mex)	\$9,973,747	3.16 %
M	BONOS	270603	AAA(mex)	\$8,740,906	2.77 %
	Certificados de la Tesorería de la Federación			\$68,416,884	21.66 %
BI	CETES	241003	AAA(mex)	\$28,370,061	8.98 %
BI	CETES	250515	AAA(mex)	\$17,872,218	5.66 %
BI	CETES	250710	AAA(mex)	\$17,539,094	5.55 %
BI	CETES	250320	AAA(mex)	\$4,635,511	1.47 %
	Udibonos			\$20,618,779	6.53 %
S	UDIBONO	311127	AAA(mex)	\$20,618,779	6.53 %
	Total Deuda Gubernamental			\$217,973,065	69.01 %
Deuda Bancaria					
	Certificados de Depósito			\$20,043,710	6.35 %
F	HSBCMX	24006	F1+ (mex)	\$20,043,710	6.35 %
	Total Deuda Bancaria			\$20,043,710	6.35 %
Otros Títulos de Deuda					
	Acciones de Fondos de Inversión de Deuda			\$50,425,864	15.96 %
51	NTEMP+	FF	AAAf/S4 (mex)	\$20,195,700	6.39 %
51	NTEMPG	FF	AAAf/S4 (mex)	\$20,152,452	6.38 %
51	NTELP	FF	AAAf/S5 (mex)	\$10,077,712	3.19 %
	Total Otros Títulos de Deuda			\$50,425,864	15.96 %
	TOTAL DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES			\$288,442,639	91.31 %
	TOTAL DE INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS			\$288,442,639	91.31 %
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADOR					
	Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)			\$27,435,771	8.69 %
IQ	BPAG91	250102	AAA(mex)	\$27,435,771	8.69 %
	TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE			\$27,435,771	8.69 %

T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
TOTAL DE CARTERA:				\$315,878,411	100.00%
Límite Máximo de VaR: 2.300%			VaR Promedio: 0.2634%		
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.					
El Fondo no realizará estrategias temporales de Inversión.					

