

Composición de la Cartera de Inversión al 31 de diciembre de 2021.

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 de Desarrollo del Gobierno Federal LD			\$25,773,164	12.04 %
LD	BONDESD	231221	AAA(mex)	\$14,984,604	7.00 %
LD	BONDESD	221110	AAA(mex)	\$10,030,336	4.69 %
LD	BONDESD	230309	AAA(mex)	\$758,224	0.35 %
	Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)			\$10,071,473	4.71 %
IQ	BPAG91	250102	AAA(mex)	\$10,071,473	4.71 %
	Udibonos			\$94,135,837	43.98 %
S	UDIBONO	231116	AAA(mex)	\$50,662,021	23.67 %
S	UDIBONO	220609	AAA(mex)	\$43,473,816	20.31 %
	Total Deuda Gubernamental			\$129,980,474	60.73 %
Deuda Bancaria					
	Pagaré con Rendimiento Liquidable al Vencimiento			\$15,006,787	7.01 %
I	BACMEXT	22011	F1+ (mex)	\$15,006,787	7.01 %
	Total Deuda Bancaria			\$15,006,787	7.01 %
Otros Títulos de Deuda					
	Certificados Bursátiles Corporativos			\$14,846,329	6.94 %
91	ARRENCB	21	mxAAA	\$5,082,930	2.37 %
91	TIPMXCB	20-2	AAA (mex)	\$5,037,220	2.35 %
91	CRELCB	19	AAA (mex)	\$4,726,179	2.21 %
	Total Otros Títulos de Deuda			\$14,846,329	6.94 %
TOTAL DE TÍTULOS PARA NEGOCIAR				\$159,833,590	74.68 %
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES				\$159,833,590	74.68 %
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADOR					
	Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)			\$54,203,325	25.32 %
IQ	BPAG91	260507	AAA(mex)	\$54,203,325	25.32 %
	TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE			\$54,203,325	25.32 %
TOTAL DE CARTERA:				\$214,036,915	100.00%
Límite Máximo de VaR: 2.300%			VaR Promedio: 0.0549%		
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	\$5,082,930	2.37 %
91	CRELCB	19	AAA (mex)	\$4,726,179	2.21 %
91	TIPMXCB	20-2	AAA (mex)	\$5,037,220	2.35 %
Total:				\$14,846,329	6.94%

"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"

