

Composición de la Cartera de Inversión al 31 de mayo 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)			\$109,767,723	37.30 %
M	BONOS	310529	AAA(mex)	\$28,024,236	9.52 %
M	BONOS	330526	AAA(mex)	\$27,072,286	9.20 %
M	BONOS	381118	AAA(mex)	\$18,844,071	6.40 %
M	BONOS	421113	AAA(mex)	\$17,212,034	5.85 %
M	BONOS	290531	AAA(mex)	\$9,890,484	3.36 %
M	BONOS	270603	AAA(mex)	\$8,724,612	2.96 %
	Certificados de la Tesorería de la Federación			\$69,497,359	23.62 %
BI	CETES	241003	AAA(mex)	\$28,903,647	9.82 %
BI	CETES	250515	AAA(mex)	\$18,122,494	6.16 %
BI	CETES	250710	AAA(mex)	\$17,759,044	6.03 %
BI	CETES	250320	AAA(mex)	\$4,712,174	1.60 %
	Udibonos			\$20,392,850	6.93 %
S	UDIBONO	311127	AAA(mex)	\$20,392,850	6.93 %
	Total Deuda Gubernamental			\$199,657,932	67.85 %
Deuda Bancaria					
	Certificados de Depósito			\$20,092,908	6.83 %
F	HSBCMX	24006	F1+ (mex)	\$20,092,908	6.83 %
	Total Deuda Bancaria			\$20,092,908	6.83 %
	TOTAL DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES			\$219,750,840	74.68 %
	TOTAL DE INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS			\$219,750,840	74.68 %
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADOR					
	Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)			\$74,517,967	25.32 %
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	\$74,517,967	25.32 %
	TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE			\$74,517,967	25.32 %
	TOTAL DE CARTERA:			\$294,268,808	100.00%
Límite Máximo de VaR: 2.300%			VaR Promedio: 0.2044%		
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 501 observaciones.					
El Fondo no realizará estrategias temporales de Inversión.					

