

Composición de la Cartera de Inversión al 18 de abril 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)			\$159,417,302	52.72 %
M	BONOS	330526	AAA(mex)	\$61,738,578	20.42 %
M	BONOS	421113	AAA(mex)	\$33,493,089	11.08 %
M	BONOS	310529	AAA(mex)	\$27,492,260	9.09 %
M	BONOS	381118	AAA(mex)	\$18,365,122	6.07 %
M	BONOS	290531	AAA(mex)	\$9,722,323	3.21 %
M	BONOS	270603	AAA(mex)	\$8,605,930	2.85 %
	Certificados de la Tesorería de la Federación			\$68,629,719	22.69 %
BI	CETES	241003	AAA(mex)	\$28,514,682	9.43 %
BI	CETES	250515	AAA(mex)	\$17,938,182	5.93 %
BI	CETES	250710	AAA(mex)	\$17,522,878	5.79 %
BI	CETES	250320	AAA(mex)	\$4,653,977	1.54 %
	Udibonos			\$19,700,668	6.51 %
S	UDIBONO	311127	AAA(mex)	\$19,700,668	6.51 %
	Total Deuda Gubernamental			\$247,747,689	81.92 %
Deuda Bancaria					
	Certificados de Depósito			\$20,162,606	6.67 %
F	HSBCMX	24006	F1+ (mex)	\$20,162,606	6.67 %
	Total Deuda Bancaria			\$20,162,606	6.67 %
Otros Títulos de Deuda					
	Acciones de Fondos de Inversión de Deuda			\$20,065,301	6.64 %
51	NTELP	FF	AAAf/S5 (mex)	\$10,040,376	3.32 %
51	NTEMPG	FF	AAAf/S4 (mex)	\$10,024,925	3.32 %
	Total Otros Títulos de Deuda			\$20,065,301	6.64 %
	TOTAL DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES			\$287,975,596	95.23 %
	TOTAL DE INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS			\$287,975,596	95.23 %
OPERACIONES DE REPORTO					
REPORTADOR					
	Bonos de Protección al Ahorro (Pago Semestral)			\$14,433,900	4.77 %
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	\$14,433,900	4.77 %
	TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTO			\$14,433,900	4.77 %

T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
TOTAL DE CARTERA:				\$302,409,497	100.00%
Límite Máximo de VaR: 2.300%			VaR Promedio: 0.2759%		
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.					

