BANORTE | OPERADORA DE FONDOS

NTERTD

Composición de la Cartera de Inversión al 05 de diciembre de 2024.

NTERTD

Fondo Banorte 31, S.A. de C.V. Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda

Categoria: Discrecional
Calificación: AAAf/S4(mex)

T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
EFECTIVO Y EQUIVALENTES DE EFECTIVO					
	Chequera en Pesos			**$1**	**0.00 %**
CHM	040072	7147252	N/A	$1	0.00 %
	TOTAL DE EFECTIVO Y EQUIVALENTES DE EFECTIVO			**$1**	**0.00 %**
INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS					
INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES					
Deuda Gubernamental					
	Bonos del Gobierno Federal (Tasa Fija)			**$165,921,232**	**54.64 %**
M	BONOS	270603	AAA(mex)	$46,719,433	15.38 %
M	BONOS	341123	AAA(mex)	$38,610,368	12.71 %
M	BONOS	310529	AAA(mex)	$27,078,548	8.92 %
M	BONOS	381118	AAA(mex)	$17,635,781	5.81 %
M	BONOS	290301	AAA(mex)	$9,777,814	3.22 %
M	BONOS	290531	AAA(mex)	$9,551,930	3.15 %
M	BONOS	330526	AAA(mex)	$8,609,055	2.84 %
M	BONOS	421113	AAA(mex)	$7,938,303	2.61 %
	Certificados de la Tesorería de la Federación			**$43,009,816**	**14.16 %**
BI	CETES	250515	AAA(mex)	$19,152,886	6.31 %
BI	CETES	250710	AAA(mex)	$18,871,130	6.21 %
BI	CETES	250320	AAA(mex)	$4,985,800	1.64 %
	Udibonos			**$20,787,297**	**6.85 %**
S	UDIBONO	311127	AAA(mex)	$20,787,297	6.85 %
	Total Deuda Gubernamental			**$229,718,345**	**75.65 %**
Deuda Bancaria					
	Certificados de Depósito			**$20,025,726**	**6.59 %**
F	HSBCMX	24006	F1+ (mex)	$20,025,726	6.59 %
	Total Deuda Bancaria			**$20,025,726**	**6.59 %**
TOTAL DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES				**$249,744,071**	**82.24 %**
	TOTAL DE INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS			**$249,744,071**	**82.24 %**
OPERACIONES DE REPORTO					
REPORTADOR					
	Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)			**$53,925,445**	**17.76 %**
IQ	BPAG91	280907	AAA(mex)	$53,925,445	17.76 %
	TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTO			**$53,925,445**	**17.76 %**
	TOTAL DE CARTERA:			**$303,669,517**	**100.00%**

Límite Máximo de VaR: 2.300% **VaR Promedio: 0.4819%**

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.

FitchRatings Excelente ★★★★★ Calificación de Calidad de Administración de Inversiones
Swiss Certified ISO 9001: 2015 Diseño y ejecución del proceso de inversión de Fondos y Administración de Portafolios.
Signatory of: PRI Principles for Responsible Investment