

Composición de la Cartera de Inversión al 13 de junio de 2024.

| <b>NTERTD</b>  |   |         |            |                       |                 |
|--|---|---------|------------|-----------------------|-----------------|
| 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 |
| <b>EFFECTIVO Y EQUIVALENTES DE EFFECTIVO</b>   |   |         |            |                       |                 |
|  | <b>Chequera en Pesos</b>                                |         |            | <b>\$1</b>            | <b>0.00 %</b>   |
| CHM  | 040072  | 7147252 | N/A        | \$1                   | 0.00 %          |
|  | <b>TOTAL DE EFFECTIVO Y EQUIVALENTES DE EFFECTIVO</b>   |         |            | <b>\$1</b>            | <b>0.00 %</b>   |
| <b>INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS</b>   |   |         |            |                       |                 |
| <b>INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES</b>  |   |         |            |                       |                 |
| <b>Deuda Gubernamental</b>   |   |         |            |                       |                 |
|  | <b>Bonos del Gobierno Federal (Tasa Fija)</b>           |         |            | <b>\$120,265,129</b>  | <b>41.98 %</b>  |
| M  | BONOS   | 310529  | AAA(mex)   | \$26,498,882          | 9.25 %          |
| M  | BONOS   | 330526  | AAA(mex)   | \$25,468,348          | 8.89 %          |
| M  | BONOS   | 381118  | AAA(mex)   | \$17,535,387          | 6.12 %          |
| M  | BONOS   | 341123  | AAA(mex)   | \$17,019,018          | 5.94 %          |
| M  | BONOS   | 421113  | AAA(mex)   | \$16,034,672          | 5.60 %          |
| M  | BONOS   | 290531  | AAA(mex)   | \$9,369,456           | 3.27 %          |
| M  | BONOS   | 270603  | AAA(mex)   | \$8,339,366           | 2.91 %          |
|  | <b>Certificados de la Tesorería de la Federación</b>    |         |            | <b>\$69,732,477</b>   | <b>24.34 %</b>  |
| BI   | CETES   | 241003  | AAA(mex)   | \$29,003,703          | 10.12 %         |
| BI   | CETES   | 250515  | AAA(mex)   | \$18,142,824          | 6.33 %          |
| BI   | CETES   | 250710  | AAA(mex)   | \$17,858,476          | 6.23 %          |
| BI   | CETES   | 250320  | AAA(mex)   | \$4,727,474           | 1.65 %          |
|  | <b>Udibonos</b>   |         |            | <b>\$19,528,850</b>   | <b>6.82 %</b>   |
| S  | UDIBONO   | 311127  | AAA(mex)   | \$19,528,850          | 6.82 %          |
|  | <b>Total Deuda Gubernamental</b>                        |         |            | <b>\$209,526,456</b>  | <b>73.13 %</b>  |
| <b>Deuda Bancaria</b>  |   |         |            |                       |                 |
|  | <b>Certificados de Depósito</b>                         |         |            | <b>\$20,162,084</b>   | <b>7.04 %</b>   |
| F  | HSBCMX  | 24006   | F1+ (mex)  | \$20,162,084          | 7.04 %          |
|  | <b>Total Deuda Bancaria</b>                             |         |            | <b>\$20,162,084</b>   | <b>7.04 %</b>   |
|  | <b>TOTAL DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES</b>    |         |            | <b>\$229,688,540</b>  | <b>80.17 %</b>  |
|  | <b>TOTAL DE INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS</b> |         |            | <b>\$229,688,540</b>  | <b>80.17 %</b>  |
| <b>OPERACIONES DE REPORTE</b>  |   |         |            |                       |                 |
| <b>REPORTADOR</b>  |   |         |            |                       |                 |
|  | <b>Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)</b>  |         |            | <b>\$56,810,843</b>   | <b>19.83 %</b>  |
| IQ   | BPAG91  | 270909  | AAA(mex)   | \$56,810,843          | 19.83 %         |
|  | <b>TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE</b>                  |         |            | <b>\$56,810,843</b>   | <b>19.83 %</b>  |
|  | <b>TOTAL DE CARTERA:</b>                                |         |            | <b>\$286,499,384</b>  | <b>100.00%</b>  |
| Límite Máximo de VaR: 2.300% <span style="float: right;">VaR Promedio: 0.2390%</span>  |   |         |            |                       |                 |
| 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.   |   |         |            |                       |                 |

