

Composición de la Cartera de Inversión al 29 de mayo de 2026.

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)				\$456,304,961	63.10 %
M	BONOS	360221	AAA(mex)	\$103,819,868	14.36 %
M	BONOS	341123	AAA(mex)	\$91,015,873	12.59 %
M	BONOS	310529	AAA(mex)	\$70,461,362	9.74 %
M	BONOS	381118	AAA(mex)	\$63,380,282	8.76 %
M	BONOS	330526	AAA(mex)	\$57,714,236	7.98 %
M	BONOS	320415	AAA(mex)	\$38,899,310	5.38 %
M	BONOS	421113	AAA(mex)	\$31,014,030	4.29 %
Certificados de la Tesorería de la Federación				\$143,012,735	19.78 %
BI	CETES	270902	AAA(mex)	\$91,382,810	12.64 %
BI	CETES	270708	AAA(mex)	\$21,284,131	2.94 %
BI	CETES	261001	AAA(mex)	\$19,560,726	2.71 %
BI	CETES	260917	AAA(mex)	\$10,785,068	1.49 %
Udibonos				\$54,188,852	7.49 %
S	UDIBONO	311127	AAA(mex)	\$54,188,852	7.49 %
Total Deuda Gubernamental				\$653,506,548	90.37 %
TOTAL DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES				\$653,506,548	90.37 %
TOTAL DE INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS				\$653,506,548	90.37 %
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADOR					
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Semestral)				\$69,623,089	9.63 %
IS	BPA182	300328	AAA(mex)	\$69,623,089	9.63 %
TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE				\$69,623,089	9.63 %
TOTAL DE CARTERA:				\$723,129,638	100.00%
Límite Máximo de VaR: 2.300%			VaR Promedio: 0.6013%		
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.					

