

**Composición de la Cartera de Inversión al 30 de junio de 2022.**

<b>NTEMPG</b>					
Fondo Banorte 12, S.A. de C.V. Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda					
Categoría: Mediano Plazo Gubernamental					
Calificación: AAAf/S4(mex)					
T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
<b>INVERSIONES EN VALORES</b>					
<b>TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>					
<b>Deuda Gubernamental</b>					
<b>Bonos del Gobierno Federal (Tasa Fija)</b>				<b>\$1,918,101,749</b>	<b>89.86 %</b>
M	BONOS	240905	AAA(mex)	\$551,039,132	25.81 %
M	BONOS	241205	AAA(mex)	\$438,793,418	20.56 %
M	BONOS	231207	AAA(mex)	\$401,525,492	18.81 %
M	BONOS	260305	AAA(mex)	\$226,744,733	10.62 %
M	BONOS	270603	AAA(mex)	\$156,900,311	7.35 %
M	BONOS	250306	AAA(mex)	\$91,299,093	4.28 %
M	BONOS	270304	AAA(mex)	\$50,795,402	2.38 %
M	BONOS	230309	AAA(mex)	\$1,004,168	0.05 %
<b>Certificados de la Tesorería de la Federación</b>				<b>\$148,079,858</b>	<b>6.94 %</b>
BI	CETES	221020	AAA(mex)	\$39,953,750	1.87 %
BI	CETES	221117	AAA(mex)	\$29,030,274	1.36 %
BI	CETES	221215	AAA(mex)	\$28,812,594	1.35 %
BI	CETES	230504	AAA(mex)	\$18,495,674	0.87 %
BI	CETES	230209	AAA(mex)	\$11,346,011	0.53 %
BI	CETES	230309	AAA(mex)	\$11,262,112	0.53 %
BI	CETES	230601	AAA(mex)	\$9,179,443	0.43 %
<b>Total Deuda Gubernamental</b>				<b>\$2,066,181,607</b>	<b>96.79 %</b>
<b>TOTAL DE TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>				<b>\$2,066,181,607</b>	<b>96.79 %</b>
<b>TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES</b>				<b>\$2,066,181,607</b>	<b>96.79 %</b>
<b>OPERACIONES DE REPORTE</b>					
<b>REPORTADOR</b>					
<b>Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LD</b>				<b>\$34,229,489</b>	<b>1.60 %</b>
LD	BONDESD	230706	AAA(mex)	\$34,229,489	1.60 %
<b>Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)</b>				<b>\$34,229,495</b>	<b>1.60 %</b>
IQ	BPAG91	260903	AAA(mex)	\$34,229,495	1.60 %
<b>TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE</b>				<b>\$68,458,984</b>	<b>3.21 %</b>
<b>TOTAL DE CARTERA:</b>				<b>\$2,134,640,591</b>	<b>100.00%</b>
<b>Limite Máximo de VaR: 0.330%</b>			<b>VaR Promedio: 0.2036%</b>		
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 500 observaciones.					
Actualmente el Fondo no se encuentra en estrategia temporal de inversión.					

