

Composición de la Cartera de Inversión al 31 de mayo de 2024.

NTEMPG					
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
INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS					
INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES					
Deuda Gubernamental					
Bonos del Gobierno Federal (Tasa Fija)				\$2,025,444,619	97.35 %
M	BONOS	260305	AAA(mex)	\$663,277,509	31.88 %
M	BONOS	270304	AAA(mex)	\$544,097,193	26.15 %
M	BONOS	260903	AAA(mex)	\$322,259,058	15.49 %
M	BONOS	270603	AAA(mex)	\$321,841,248	15.47 %
M	BONOS	290301	AAA(mex)	\$173,969,611	8.36 %
Certificados de la Tesorería de la Federación				\$37,391,592	1.80 %
BI	CETES	241003	AAA(mex)	\$19,269,098	0.93 %
BI	CETES	250515	AAA(mex)	\$18,122,494	0.87 %
Total Deuda Gubernamental				\$2,062,836,211	99.14 %
TOTAL DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES				\$2,062,836,211	99.14 %
TOTAL DE INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS				\$2,062,836,211	99.14 %
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADOR					
Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LF				\$8,905,169	0.43 %
LF	BONDESF	290322	AAA(mex)	\$8,905,169	0.43 %
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)				\$8,905,139	0.43 %
IQ	BPAG91	251231	AAA(mex)	\$8,905,139	0.43 %
TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE				\$17,810,308	0.86 %
TOTAL DE CARTERA:				\$2,080,646,519	100.00%
Límite Máximo de VaR: 0.330%			VaR Promedio: 0.2146%		
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.					
Actualmente el Fondo no se encuentra en estrategia temporal de inversión.					

