

Composición de la Cartera de Inversión al 18 de abril 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)				\$2,034,462,737	96.82 %
M	BONOS	260305	AAA(mex)	\$691,390,619	32.90 %
M	BONOS	270304	AAA(mex)	\$536,428,830	25.53 %
M	BONOS	260903	AAA(mex)	\$318,036,700	15.14 %
M	BONOS	270603	AAA(mex)	\$317,463,207	15.11 %
M	BONOS	290301	AAA(mex)	\$171,143,381	8.14 %
Certificados de la Tesorería de la Federación				\$36,947,970	1.76 %
BI	CETES	241003	AAA(mex)	\$19,009,788	0.90 %
BI	CETES	250515	AAA(mex)	\$17,938,182	0.85 %
Total Deuda Gubernamental				\$2,071,410,707	98.58 %
TOTAL DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES				\$2,071,410,707	98.58 %
TOTAL DE INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS				\$2,071,410,707	98.58 %
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADOR					
Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LF				\$14,905,694	0.71 %
LF	BONDESF	270128	AAA(mex)	\$14,905,694	0.71 %
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Semestral)				\$14,905,532	0.71 %
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	\$14,905,532	0.71 %
TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE				\$29,811,226	1.42 %
TOTAL DE CARTERA:				\$2,101,221,933	100.00%
Límite Máximo de VaR: 0.330%			VaR Promedio: 0.1995%		
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.					

