

Composición de la Cartera de Inversión al 20 de junio 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)				\$2,011,644,151	97.93 %
M	BONOS	260305	AAA(mex)	\$663,821,381	32.32 %
M	BONOS	270304	AAA(mex)	\$543,791,454	26.47 %
M	BONOS	260903	AAA(mex)	\$322,267,711	15.69 %
M	BONOS	270603	AAA(mex)	\$308,877,561	15.04 %
M	BONOS	290301	AAA(mex)	\$172,886,044	8.42 %
Certificados de la Tesorería de la Federación				\$37,555,148	1.83 %
BI	CETES	241003	AAA(mex)	\$19,375,882	0.94 %
BI	CETES	250515	AAA(mex)	\$18,179,266	0.88 %
Total Deuda Gubernamental				\$2,049,199,299	99.76 %
TOTAL DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES				\$2,049,199,299	99.76 %
TOTAL DE INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS				\$2,049,199,299	99.76 %
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADOR					
Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LF				\$2,482,129	0.12 %
LF	BONDESF	261231	AAA(mex)	\$2,482,129	0.12 %
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)				\$2,482,131	0.12 %
IQ	BPAG91	250102	AAA(mex)	\$2,482,131	0.12 %
TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE				\$4,964,260	0.24 %
TOTAL DE CARTERA:				\$2,054,163,559	100.00%
Límite Máximo de VaR: 0.330%			VaR Promedio: 0.2211%		
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.					

