

Composición de la Cartera de Inversión al 13 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)				\$2,005,570,814	97.88 %
M	BONOS	260305	AAA(mex)	\$662,349,144	32.32 %
M	BONOS	270304	AAA(mex)	\$541,934,419	26.45 %
M	BONOS	260903	AAA(mex)	\$321,106,560	15.67 %
M	BONOS	270603	AAA(mex)	\$307,629,942	15.01 %
M	BONOS	290301	AAA(mex)	\$172,550,749	8.42 %
Certificados de la Tesorería de la Federación				\$37,478,626	1.83 %
BI	CETES	241003	AAA(mex)	\$19,335,802	0.94 %
BI	CETES	250515	AAA(mex)	\$18,142,824	0.89 %
Total Deuda Gubernamental				\$2,043,049,440	99.71 %
TOTAL DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES				\$2,043,049,440	99.71 %
TOTAL DE INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS				\$2,043,049,440	99.71 %
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADOR					
Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LF				\$2,997,646	0.15 %
LF	BONDES F	270318	AAA(mex)	\$2,997,646	0.15 %
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)				\$2,997,659	0.15 %
IQ	BPAG91	270909	AAA(mex)	\$2,997,659	0.15 %
TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE				\$5,995,305	0.29 %
TOTAL DE CARTERA:				\$2,049,044,745	100.00%
Límite Máximo de VaR: 0.330%				VaR Promedio: 0.2137%	
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.					

