

Composición de la Cartera de Inversión al 29 de mayo de 2026.

| 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) | | | | \$5,329,324,742 | 91.21 % |
| M | BONOS | 290301 | AAA(mex) | \$1,739,127,518 | 29.77 % |
| M | BONOS | 280302 | AAA(mex) | \$1,245,868,047 | 21.32 % |
| M | BONOS | 270603 | AAA(mex) | \$1,150,850,534 | 19.70 % |
| M | BONOS | 290531 | AAA(mex) | \$598,772,917 | 10.25 % |
| M | BONOS | 300228 | AAA(mex) | \$594,705,726 | 10.18 % |
| Certificados de la Tesorería de la Federación | | | | \$493,122,680 | 8.44 % |
| BI | CETES | 261001 | AAA(mex) | \$44,011,634 | 0.75 % |
| BI | CETES | 270513 | AAA(mex) | \$42,148,611 | 0.72 % |
| BI | CETES | 270318 | AAA(mex) | \$37,898,680 | 0.65 % |
| BI | CETES | 270121 | AAA(mex) | \$37,348,186 | 0.64 % |
| BI | CETES | 260611 | AAA(mex) | \$36,933,189 | 0.63 % |
| BI | CETES | 270708 | AAA(mex) | \$33,314,292 | 0.57 % |
| BI | CETES | 271028 | AAA(mex) | \$31,601,679 | 0.54 % |
| BI | CETES | 271223 | AAA(mex) | \$27,626,893 | 0.47 % |
| BI | CETES | 270902 | AAA(mex) | \$25,587,187 | 0.44 % |
| BI | CETES | 280217 | AAA(mex) | \$23,753,239 | 0.41 % |
| BI | CETES | 261126 | AAA(mex) | \$22,257,213 | 0.38 % |
| BI | CETES | 260806 | AAA(mex) | \$21,738,952 | 0.37 % |
| BI | CETES | 280412 | AAA(mex) | \$14,751,223 | 0.25 % |
| BI | CETES | 260625 | AAA(mex) | \$9,956,649 | 0.17 % |
| BI | CETES | 260723 | AAA(mex) | \$9,906,331 | 0.17 % |
| BI | CETES | 260820 | AAA(mex) | \$9,856,432 | 0.17 % |
| BI | CETES | 260917 | AAA(mex) | \$9,804,607 | 0.17 % |
| BI | CETES | 261210 | AAA(mex) | \$9,652,145 | 0.17 % |
| BI | CETES | 270107 | AAA(mex) | \$9,602,400 | 0.16 % |
| BI | CETES | 270204 | AAA(mex) | \$9,550,728 | 0.16 % |
| BI | CETES | 261112 | AAA(mex) | \$5,821,988 | 0.10 % |
| BI | CETES | 270401 | AAA(mex) | \$5,670,500 | 0.10 % |
| BI | CETES | 261015 | AAA(mex) | \$4,878,339 | 0.08 % |
| BI | CETES | 270304 | AAA(mex) | \$4,751,211 | 0.08 % |
| BI | CETES | 270429 | AAA(mex) | \$4,700,372 | 0.08 % |
| Total Deuda Gubernamental | | | | \$5,822,447,422 | 99.65 % |
| TOTAL DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES | | | | \$5,822,447,422 | 99.65 % |
| TOTAL DE INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS | | | | \$5,822,447,422 | 99.65 % |
| OPERACIONES DE REPORTO | | | | | |
| REPORTADOR | | | | | |
| Bonos de Protección al Ahorro (Pago Semestral) | | | | \$10,112,900 | 0.17 % |
| IS | BPA182 | 300328 | AAA(mex) | \$10,112,900 | 0.17 % |
| Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral) | | | | \$10,113,054 | 0.17 % |
| IQ | BPAG91 | 300516 | AAA(mex) | \$10,113,054 | 0.17 % |



Signatory of:



| T. VALOR | EMISORA | SERIE | CALIF/BURS | VALOR RAZONABLE TOTAL | % PARTICIPACIÓN |
|---|---------|-------|-----------------------|--------------------------|--------------------|
| TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTO | | | | \$20,225,954 | 0.35 % |
| TOTAL DE CARTERA: | | | | \$5,842,673,376 | 100.00% |
| Límite Máximo de VaR: 0.330% | | | VaR Promedio: 0.2605% | | |
| <p>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.</p> | | | | | |
| <p>Actualmente el Fondo no se encuentra en estrategia temporal de inversión.</p> | | | | | |

