

Composición de la Cartera de Inversión al 28 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: AA Af/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)				\$5,395,269,855	91.26 %
M	BONOS	290301	AAA(mex)	\$1,753,509,681	29.66 %
M	BONOS	280302	AAA(mex)	\$1,287,068,913	21.77 %
M	BONOS	270603	AAA(mex)	\$1,150,094,857	19.45 %
M	BONOS	290531	AAA(mex)	\$640,681,508	10.84 %
M	BONOS	300228	AAA(mex)	\$563,914,896	9.54 %
Certificados de la Tesorería de la Federación				\$492,842,469	8.34 %
BI	CETES	261001	AAA(mex)	\$43,988,891	0.74 %
BI	CETES	270513	AAA(mex)	\$42,119,568	0.71 %
BI	CETES	270318	AAA(mex)	\$37,876,284	0.64 %
BI	CETES	270121	AAA(mex)	\$37,326,970	0.63 %
BI	CETES	260611	AAA(mex)	\$36,913,357	0.62 %
BI	CETES	270708	AAA(mex)	\$33,293,243	0.56 %
BI	CETES	271028	AAA(mex)	\$31,581,543	0.53 %
BI	CETES	271223	AAA(mex)	\$27,608,743	0.47 %
BI	CETES	270902	AAA(mex)	\$25,571,148	0.43 %
BI	CETES	280217	AAA(mex)	\$23,740,868	0.40 %
BI	CETES	261126	AAA(mex)	\$22,245,184	0.38 %
BI	CETES	260806	AAA(mex)	\$21,727,233	0.37 %
BI	CETES	280412	AAA(mex)	\$14,747,245	0.25 %
BI	CETES	260625	AAA(mex)	\$9,951,412	0.17 %
BI	CETES	260723	AAA(mex)	\$9,900,930	0.17 %
BI	CETES	260820	AAA(mex)	\$9,851,233	0.17 %
BI	CETES	260917	AAA(mex)	\$9,800,620	0.17 %
BI	CETES	261210	AAA(mex)	\$9,646,802	0.16 %
BI	CETES	270107	AAA(mex)	\$9,597,036	0.16 %
BI	CETES	270204	AAA(mex)	\$9,545,455	0.16 %
BI	CETES	261112	AAA(mex)	\$5,818,754	0.10 %
BI	CETES	270401	AAA(mex)	\$5,667,476	0.10 %
BI	CETES	261015	AAA(mex)	\$4,876,468	0.08 %
BI	CETES	270304	AAA(mex)	\$4,748,643	0.08 %
BI	CETES	270429	AAA(mex)	\$4,697,363	0.08 %
Total Deuda Gubernamental				\$5,888,112,324	99.59 %
TOTAL DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES				\$5,888,112,324	99.59 %
TOTAL DE INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS				\$5,888,112,324	99.59 %
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADOR					
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Semestral)				\$12,021,346	0.20 %
IS	BPA182	310327	AAA(mex)	\$12,021,346	0.20 %
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)				\$12,021,324	0.20 %
IQ	BPAG91	300912	AAA(mex)	\$12,021,324	0.20 %



T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTO				\$24,042,670	0.41 %
TOTAL DE CARTERA:				\$5,912,154,994	100.00%
Límite Máximo de VaR: 0.330%			VaR Promedio: 0.2564%		
<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>					

