

Composición de la Cartera de Inversión al 30 de abril 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)				\$5,623,210,704	91.07 %
M	BONOS	290301	AAA(mex)	\$1,812,656,807	29.36 %
M	BONOS	280302	AAA(mex)	\$1,320,727,896	21.39 %
M	BONOS	270603	AAA(mex)	\$1,225,137,040	19.84 %
M	BONOS	290531	AAA(mex)	\$686,357,214	11.12 %
M	BONOS	300228	AAA(mex)	\$578,331,747	9.37 %
Certificados de la Tesorería de la Federación				\$520,531,677	8.43 %
BI	CETES	261001	AAA(mex)	\$43,762,631	0.71 %
BI	CETES	270513	AAA(mex)	\$41,874,377	0.68 %
BI	CETES	270318	AAA(mex)	\$37,660,240	0.61 %
BI	CETES	270121	AAA(mex)	\$37,125,231	0.60 %
BI	CETES	260611	AAA(mex)	\$36,740,637	0.60 %
BI	CETES	270708	AAA(mex)	\$33,081,368	0.54 %
BI	CETES	271028	AAA(mex)	\$31,368,211	0.51 %
BI	CETES	260528	AAA(mex)	\$29,867,637	0.48 %
BI	CETES	271223	AAA(mex)	\$27,420,535	0.44 %
BI	CETES	270902	AAA(mex)	\$25,397,694	0.41 %
BI	CETES	280217	AAA(mex)	\$23,569,545	0.38 %
BI	CETES	261126	AAA(mex)	\$22,134,446	0.36 %
BI	CETES	260806	AAA(mex)	\$21,622,766	0.35 %
BI	CETES	260514	AAA(mex)	\$19,962,380	0.32 %
BI	CETES	260625	AAA(mex)	\$9,905,576	0.16 %
BI	CETES	260723	AAA(mex)	\$9,854,735	0.16 %
BI	CETES	260820	AAA(mex)	\$9,801,784	0.16 %
BI	CETES	260917	AAA(mex)	\$9,750,043	0.16 %
BI	CETES	261210	AAA(mex)	\$9,596,398	0.16 %
BI	CETES	270107	AAA(mex)	\$9,546,695	0.15 %
BI	CETES	270204	AAA(mex)	\$9,493,474	0.15 %
BI	CETES	261112	AAA(mex)	\$5,790,016	0.09 %
BI	CETES	270401	AAA(mex)	\$5,632,430	0.09 %
BI	CETES	261015	AAA(mex)	\$4,850,382	0.08 %
BI	CETES	270304	AAA(mex)	\$4,722,446	0.08 %
Total Deuda Gubernamental				\$6,143,742,381	99.50 %
TOTAL DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES				\$6,143,742,381	99.50 %
TOTAL DE INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS				\$6,143,742,381	99.50 %
OPERACIONES DE REPORTO					
REPORTADOR					
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)				\$31,028,987	0.50 %
IQ	BPAG91	280907	AAA(mex)	\$15,514,522	0.25 %
IQ	BPAG91	280106	AAA(mex)	\$15,514,465	0.25 %
TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTO				\$31,028,987	0.50 %

T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
TOTAL DE CARTERA:				\$6,174,771,368	100.00%
Límite Máximo de VaR: 0.330%		VaR Promedio: 0.2783%			
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.					

