

Composición de la Cartera de Inversión al 28 de junio de 2024.

<b>NTEMPG</b>					
<b>Fondo Banorte 12, S.A. de C.V. Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda</b>					
Categoría: Mediano Plazo Gubernamental					
Calificación: AAAf/S4(mex)					
T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
<b>INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS</b>					
<b>INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES</b>					
<b>Deuda Gubernamental</b>					
<b>Bonos del Gobierno Federal (Tasa Fija)</b>				<b>\$1,807,521,662</b>	<b>97.60 %</b>
M	BONOS	260305	AAA(mex)	\$413,457,783	22.33 %
M	BONOS	270304	AAA(mex)	\$375,185,865	20.26 %
M	BONOS	270603	AAA(mex)	\$330,005,438	17.82 %
M	BONOS	260903	AAA(mex)	\$277,113,296	14.96 %
M	BONOS	290531	AAA(mex)	\$237,372,105	12.82 %
M	BONOS	290301	AAA(mex)	\$174,387,175	9.42 %
<b>Certificados de la Tesorería de la Federación</b>				<b>\$37,662,512</b>	<b>2.03 %</b>
BI	CETES	241003	AAA(mex)	\$19,434,194	1.05 %
BI	CETES	250515	AAA(mex)	\$18,228,318	0.98 %
<b>Total Deuda Gubernamental</b>				<b>\$1,845,184,174</b>	<b>99.64 %</b>
<b>TOTAL DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES</b>				<b>\$1,845,184,174</b>	<b>99.64 %</b>
<b>TOTAL DE INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS</b>				<b>\$1,845,184,174</b>	<b>99.64 %</b>
<b>OPERACIONES DE REPORTE</b>					
<b>REPORTADOR</b>					
<b>Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LF</b>				<b>\$3,354,860</b>	<b>0.18 %</b>
LF	BONDEF	261231	AAA(mex)	\$3,354,860	0.18 %
<b>Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)</b>				<b>\$3,354,829</b>	<b>0.18 %</b>
IQ	BPAG91	270909	AAA(mex)	\$3,354,829	0.18 %
<b>TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE</b>				<b>\$6,709,689</b>	<b>0.36 %</b>
<b>TOTAL DE CARTERA:</b>				<b>\$1,851,893,863</b>	<b>100.00%</b>
<b>Límite Máximo de VaR: 0.330%</b>			<b>VaR Promedio: 0.2225%</b>		
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.					
<b>Actualmente el Fondo no se encuentra en estrategia temporal de inversión.</b>					

