

Composición de la Cartera de Inversión al 27 de marzo 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)				\$2,125,977,275	96.09 %
M	BONOS	260305	AAA(mex)	\$695,164,870	31.42 %
M	BONOS	270304	AAA(mex)	\$563,147,219	25.45 %
M	BONOS	270603	AAA(mex)	\$371,002,915	16.77 %
M	BONOS	260903	AAA(mex)	\$321,193,373	14.52 %
M	BONOS	290301	AAA(mex)	\$175,468,898	7.93 %
Certificados de la Tesorería de la Federación				\$36,785,592	1.66 %
BI	CETES	241003	AAA(mex)	\$18,913,374	0.85 %
BI	CETES	250515	AAA(mex)	\$17,872,218	0.81 %
Total Deuda Gubernamental				\$2,162,762,867	97.75 %
TOTAL DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES				\$2,162,762,867	97.75 %
TOTAL DE INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS				\$2,162,762,867	97.75 %
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADOR					
Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LF				\$24,907,342	1.13 %
LF	BONDES F	270318	AAA(mex)	\$24,907,342	1.13 %
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)				\$24,907,224	1.13 %
IQ	BPAG91	250102	AAA(mex)	\$24,907,224	1.13 %
TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE				\$49,814,566	2.25 %
TOTAL DE CARTERA:				\$2,212,577,433	100.00%
Límite Máximo de VaR: 0.330%			VaR Promedio: 0.1898%		
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.					

