

Composición de la Cartera de Inversión al 25 de abril 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)				\$2,033,712,135	97.07 %
M	BONOS	260305	AAA(mex)	\$691,254,970	32.99 %
M	BONOS	270304	AAA(mex)	\$536,240,007	25.59 %
M	BONOS	260903	AAA(mex)	\$317,667,039	15.16 %
M	BONOS	270603	AAA(mex)	\$317,409,762	15.15 %
M	BONOS	290301	AAA(mex)	\$171,140,357	8.17 %
Certificados de la Tesorería de la Federación				\$36,999,788	1.77 %
BI	CETES	241003	AAA(mex)	\$19,047,644	0.91 %
BI	CETES	250515	AAA(mex)	\$17,952,144	0.86 %
Total Deuda Gubernamental				\$2,070,711,923	98.83 %
TOTAL DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES				\$2,070,711,923	98.83 %
TOTAL DE INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS				\$2,070,711,923	98.83 %
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADOR					
Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal LF				\$12,210,103	0.58 %
LF	BONDESF	261231	AAA(mex)	\$12,210,103	0.58 %
Bonos de Protección al Ahorro (Pago Semestral)				\$12,210,142	0.58 %
IS	BPA182	260219	AAA(mex)	\$12,210,142	0.58 %
TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE				\$24,420,245	1.17 %
TOTAL DE CARTERA:				\$2,095,132,168	100.00%
Límite Máximo de VaR: 0.330%			VaR Promedio: 0.1930%		
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.					

