

**Composición de la Cartera de Inversión al 27 de marzo de 2024.**

<b>NTESEL</b>					
Fondo Banorte 22, S.A. de C.V. Fondo de Inversión de Renta Variable					
Categoría: Especializado en Acciones					
T. VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR RAZONABLE TOTAL	% PARTICIPACIÓN
<b>EFFECTIVO Y EQUIVALENTES DE EFFECTIVO</b>					
<b>Chequera en Pesos</b>				<b>\$1</b>	<b>0.00 %</b>
CHM	040072	7838671	N/A	\$1	0.00 %
<b>TOTAL DE EFFECTIVO Y EQUIVALENTES DE EFFECTIVO</b>				<b>\$1</b>	<b>0.00 %</b>
<b>INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS</b>					
<b>INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES</b>					
<b>Instrumentos financieros de capital</b>					
<b>Acciones Industriales, Comerciales y de Servicios</b>				<b>\$1,002,188,006</b>	<b>98.05 %</b>
1	GFNORTE	O	Alta	\$132,982,451	13.01 %
1	AMX	B	Alta	\$119,498,600	11.69 %
1	FEMSA	UBD	Alta	\$116,618,112	11.41 %
1	GMEXICO	B	Alta	\$90,838,548	8.89 %
1	CEMEX	CPO	Alta	\$73,426,915	7.18 %
1	LAB	B	Alta	\$71,088,900	6.95 %
1	BIMBO	A	Alta	\$69,445,950	6.79 %
1	NEMAK	A	Media	\$47,502,994	4.65 %
1	BOLSA	A	Alta	\$43,498,500	4.26 %
1	VOLAR	A	Alta	\$43,400,512	4.25 %
1	ASUR	B	Alta	\$41,948,800	4.10 %
1	GENTERA	*	Alta	\$41,498,792	4.06 %
1	ALSEA	*	Alta	\$39,974,432	3.91 %
1	LIVEPOL	C-1	Alta	\$36,052,500	3.53 %
1	ALPEK	A	Alta	\$34,412,000	3.37 %
<b>Total instrumentos financieros de capital</b>				<b>\$1,002,188,006</b>	<b>98.05 %</b>
<b>TOTAL DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES</b>				<b>\$1,002,188,006</b>	<b>98.05 %</b>
<b>TOTAL DE INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS</b>				<b>\$1,002,188,006</b>	<b>98.05 %</b>
<b>OPERACIONES DE REPORTE</b>					
<b>REPORTADOR</b>					
<b>Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)</b>				<b>\$19,976,109</b>	<b>1.95 %</b>
IQ	BPAG91	250102	AAA(mex)	\$19,976,109	1.95 %
<b>TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE</b>				<b>\$19,976,109</b>	<b>1.95 %</b>
<b>TOTAL DE CARTERA:</b>				<b>\$1,022,164,116</b>	<b>100.00%</b>
<b>Límite Máximo de VaR: 3.400%</b>			<b>VaR Promedio: 2.1538%</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>					

