

**Composición de la Cartera de Inversión al 30 de junio de 2022.**

| <b>NTEUSA</b>  |         |   |                              |                        |                 |
|--|---------|---|------------------------------|------------------------|-----------------|
| Fondo Banorte 24, S.A. de C.V. Fondo de Inversión de Renta Variable  |         |   |                              |                        |                 |
| Categoría: Especializado en Acciones Internacionales   |         |   |                              |                        |                 |
| T. VALOR   | EMISORA | SERIE   | CALIF/BURS                   | VALOR RAZONABLE TOTAL  | % PARTICIPACIÓN |
| <b>INVERSIONES EN VALORES</b>  |         |   |                              |                        |                 |
| <b>TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>   |         |   |                              |                        |                 |
| <b>Instrumentos de Patrimonio Neto</b>   |         |   |                              |                        |                 |
| <b>Títulos Referenciados a Acciones, TRACS Extranjeros</b>   |         |   |                              | <b>\$3,293,775,285</b> | <b>99.74 %</b>  |
| 1ISP   | IVV     | *   | Alta                         | \$1,565,496,986        | 47.41 %         |
| 1ISP   | VOO     | *   | Alta                         | \$893,321,753          | 27.05 %         |
| 1ISP   | XLV     | *   | Alta                         | \$122,135,736          | 3.70 %          |
| 1ISP   | VTV     | *   | Alta                         | \$119,494,951          | 3.62 %          |
| 1ISP   | ESGV    | *   | Alta                         | \$105,621,730          | 3.20 %          |
| 1ISP   | SOXX    | *   | Alta                         | \$99,960,932           | 3.03 %          |
| 1ISP   | XLF     | *   | Alta                         | \$90,745,468           | 2.75 %          |
| 1ISP   | XLK     | *   | Alta                         | \$90,097,897           | 2.73 %          |
| 1ISP   | XLE     | *   | Alta                         | \$43,196,259           | 1.31 %          |
| 1ISP   | XLY     | *   | Alta                         | \$41,523,016           | 1.26 %          |
| 1ISP   | VIG     | *   | Alta                         | \$37,554,549           | 1.14 %          |
| 1ISP   | XLP     | *   | Alta                         | \$31,974,051           | 0.97 %          |
| 1ISP   | SPY     | *   | Alta                         | \$24,307,334           | 0.74 %          |
| 1ISP   | XSD     | *   | Alta                         | \$19,551,537           | 0.59 %          |
| 1ISP   | XLI     | *   | Alta                         | \$8,793,086            | 0.27 %          |
| <b>Total Instrumentos de Patrimonio Neto</b>   |         |   |                              | <b>\$3,293,775,285</b> | <b>99.74 %</b>  |
| <b>TOTAL DE TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>  |         |   |                              | <b>\$3,293,775,285</b> | <b>99.74 %</b>  |
| <b>TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES</b>   |         |   |                              | <b>\$3,293,775,285</b> | <b>99.74 %</b>  |
| <b>OPERACIONES DE REPORTE</b>  |         |   |                              |                        |                 |
| <b>REPORTADOR</b>  |         |   |                              |                        |                 |
| <b>Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)</b>   |         |   |                              | <b>\$8,421,758</b>     | <b>0.26 %</b>   |
| IQ   | BPAG91  | 260903  | AAA(mex)                     | \$8,421,758            | 0.26 %          |
| <b>TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE</b>   |         |   |                              | <b>\$8,421,758</b>     | <b>0.26 %</b>   |
| <b>TOTAL DE CARTERA:</b>   |         |   |                              | <b>\$3,302,197,043</b> | <b>100.00%</b>  |
| <b>Límite Máximo de VaR: 3.170%</b>  |         |   | <b>VaR Promedio: 2.3249%</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 500 observaciones. |         |   |                              |                        |                 |
| <b>El Fondo no realizará estrategias temporales de Inversión.</b>  |         |   |                              |                        |                 |
| 1ISP   | IVV     | <a href="https://www.ishares.com/us/products/239726/ishares-core-sp-500-etf">https://www.ishares.com/us/products/239726/ishares-core-sp-500-etf</a>   |                              |                        |                 |
| 1ISP   | VOO     | <a href="https://www.vanguardmexico.com/es/productos/productos-financieros/etf-de-renta-variable/VOO">https://www.vanguardmexico.com/es/productos/productos-financieros/etf-de-renta-variable/VOO</a> |                              |                        |                 |

