

Composición de la Cartera de Inversión al 13 de junio de 2024.

| <b>NTEAI</b>   |         |   |                              |                       |                 |
|--|---------|---|------------------------------|-----------------------|-----------------|
| Fondo Banorte 30, S.A. de C.V. Fondo de Inversión de Renta Variable  |         |   |                              |                       |                 |
| Categoría: Discrecional  |         |   |                              |                       |                 |
| T. VALOR   | EMISORA | SERIE   | CALIF/BURS                   | VALOR RAZONABLE TOTAL | % PARTICIPACIÓN |
| <b>EFFECTIVO Y EQUIVALENTES DE EFFECTIVO</b>   |         |   |                              |                       |                 |
| <b>Chequera en Pesos</b>   |         |   |                              | <b>\$26,884</b>       | <b>0.00 %</b>   |
| CHM  | 040072  | 7146581   | N/A                          | \$26,884              | 0.00 %          |
| <b>TOTAL DE EFFECTIVO Y EQUIVALENTES DE EFFECTIVO</b>  |         |   |                              | <b>\$26,884</b>       | <b>0.00 %</b>   |
| <b>INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS</b>   |         |   |                              |                       |                 |
| <b>INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES</b>  |         |   |                              |                       |                 |
| <b>Instrumentos financieros de capital</b>   |         |   |                              |                       |                 |
| <b>Títulos Referenciados a Acciones, TRACS Extranjeros</b>   |         |   |                              | <b>\$589,161,624</b>  | <b>98.27 %</b>  |
| 1ISP   | IHYA    | N   | Alta                         | \$253,040,736         | 42.21 %         |
| 1ISP   | CBU0    | N   | Alta                         | \$95,608,287          | 15.95 %         |
| 1ISP   | LQDA    | N   | Alta                         | \$82,955,560          | 13.84 %         |
| 1ISP   | IBTA    | N   | Alta                         | \$66,448,987          | 11.08 %         |
| 1ISP   | JPEA    | N   | Alta                         | \$58,152,932          | 9.70 %          |
| 1ISP   | DTLA    | N   | Alta                         | \$26,600,267          | 4.44 %          |
| 1ISP   | PFF     | *   | Alta                         | \$6,354,855           | 1.06 %          |
| <b>Total instrumentos financieros de capital</b>   |         |   |                              | <b>\$589,161,624</b>  | <b>98.27 %</b>  |
| <b>TOTAL DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES</b>   |         |   |                              | <b>\$589,161,624</b>  | <b>98.27 %</b>  |
| <b>TOTAL DE INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS</b>  |         |   |                              | <b>\$589,161,624</b>  | <b>98.27 %</b>  |
| <b>OPERACIONES DE REPORTE</b>  |         |   |                              |                       |                 |
| <b>REPORTADOR</b>  |         |   |                              |                       |                 |
| <b>Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral)</b>   |         |   |                              | <b>\$10,321,882</b>   | <b>1.72 %</b>   |
| IQ   | BPAG91  | 270909  | AAA(mex)                     | \$10,321,882          | 1.72 %          |
| <b>TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE</b>   |         |   |                              | <b>\$10,321,882</b>   | <b>1.72 %</b>   |
| <b>TOTAL DE CARTERA:</b>   |         |   |                              | <b>\$599,510,390</b>  | <b>100.00%</b>  |
| <b>Límite Máximo de VaR: 2.000%</b>  |         |   | <b>VaR Promedio: 1.2711%</b> |                       |                 |
| Valor en Riesgo (VaR) Supuestos y Metodología: Horizonte de tiempo de un día y con nivel de confianza al 95% a dos cosas basada en una simulación histórica no paramétrica de 501 observaciones. |         |   |                              |                       |                 |
| <b>El Fondo no realizará estrategias temporales de Inversión.</b>  |         |   |                              |                       |                 |
| 1ISP   | IHYA    | <a href="https://www.blackrock.com/es/profesionales/productos/287352/ishares-high-yield-corp-bond-ucits-etf">https://www.blackrock.com/es/profesionales/productos/287352/ishares-high-yield-corp-bond-ucits-etf</a>                           |                              |                       |                 |
| 1ISP   | CBU0    | <a href="https://www.blackrock.com/mx/intermediarios/productos/253745/ishares-usd-government-bond-710-ucits-etf-acc-fund">https://www.blackrock.com/mx/intermediarios/productos/253745/ishares-usd-government-bond-710-ucits-etf-acc-fund</a> |                              |                       |                 |
| 1ISP   | LQDA    | <a href="https://www.blackrock.com/mx/intermediarios/productos/287338/ishares-corp-bond-ucits-etf">https://www.blackrock.com/mx/intermediarios/productos/287338/ishares-corp-bond-ucits-etf</a>   |                              |                       |                 |
| 1ISP   | IBTA    | <a href="https://www.blackrock.com/mx/intermediarios/productos/287340/ishares-treasury-bond-1-3yr-ucits-etf">https://www.blackrock.com/mx/intermediarios/productos/287340/ishares-treasury-bond-1-3yr-ucits-etf</a>                           |                              |                       |                 |

