

Composición de la Cartera de Inversión al 20 de junio de 2024.

| NTEUSA | | | | | |
|--|---------|---|------------------------------|------------------------|-----------------|
| 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 |
| EFFECTIVO Y EQUIVALENTES DE EFFECTIVO | | | | | |
| Chequera en Pesos | | | | \$1 | 0.00 % |
| CHM | 040072 | 7839780 | N/A | \$1 | 0.00 % |
| TOTAL DE EFFECTIVO Y EQUIVALENTES DE EFFECTIVO | | | | \$1 | 0.00 % |
| INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS | | | | | |
| INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES | | | | | |
| Instrumentos financieros de capital | | | | | |
| Títulos Referenciados a Acciones, TRACS Extranjeros | | | | \$3,138,584,851 | 99.70 % |
| 1ISP | SPYL | N | Alta | \$1,787,046,325 | 56.77 % |
| 1ISP | VOO | * | Alta | \$1,194,500,208 | 37.94 % |
| 1ISP | XLK | * | Alta | \$51,281,199 | 1.63 % |
| 1ISP | XLF | * | Alta | \$31,936,021 | 1.01 % |
| 1ISP | XLV | * | Alta | \$27,701,395 | 0.88 % |
| 1ISP | XLC | * | Alta | \$14,417,743 | 0.46 % |
| 1ISP | XLE | * | Alta | \$11,939,861 | 0.38 % |
| 1ISP | XLP | * | Alta | \$9,267,325 | 0.29 % |
| 1ISP | XLU | * | Alta | \$3,590,350 | 0.11 % |
| 1ISP | XLB | * | Alta | \$3,457,769 | 0.11 % |
| 1ISP | XLY | * | Alta | \$2,993,893 | 0.10 % |
| 1ISP | XLI | * | Alta | \$452,762 | 0.01 % |
| Total instrumentos financieros de capital | | | | \$3,138,584,851 | 99.70 % |
| TOTAL DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS NEGOCIABLES | | | | \$3,138,584,851 | 99.70 % |
| TOTAL DE INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS | | | | \$3,138,584,851 | 99.70 % |
| OPERACIONES DE REPORTE | | | | | |
| REPORTADOR | | | | | |
| Bonos de Protección al Ahorro (Pago Trimestral) | | | | \$9,417,030 | 0.30 % |
| IQ | BPAG91 | 250102 | AAA(mex) | \$9,417,030 | 0.30 % |
| TOTAL DE OPERACIONES DE REPORTE | | | | \$9,417,030 | 0.30 % |
| TOTAL DE CARTERA: | | | | \$3,148,001,882 | 100.00 % |
| Límite Máximo de VaR: 3.170% | | | VaR Promedio: 1.4202% | | |
| 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. | | | | | |
| El Fondo no realizará estrategias temporales de Inversión. | | | | | |
| 1ISP | VOO | https://www.vanguardmexico.com/es/productos/productos-financieros/etf-de-renta-variable/VOO | | | |
| 1ISP | SPYL | https://www.ssga.com/uk/en_gb/institutional/etfs/funds/spdr-sp-500-ucits-etf-acc-spyl-gy | | | |

