

ESPECIALIZADO EN ACCIONES INDIZADAS AL S&P 500

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Chequera Dolares			282,944	0.00%
CHD	40-133	8036634		282,944	0.00%
	Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras			6,758,641,389	99.97%
1ISP	SPLG	*	Alta	3,359,436,486	49.69%
1ISP	VOO	*	Alta	1,684,123,658	24.91%
1ISP	USPX	*	Alta	871,839,067	12.90%
1ISP	BBUS	*	Alta	735,309,134	10.88%
1ISP	500U	N	Alta	107,933,044	1.60%
	Reportos			1,554,919	0.02%
M	BONOS	250306	AAA(mex)	1,554,919	0.02%
	TOTAL CARTERA			6,760,479,252	100.00%
	ACTIVO NETO			6,754,172,845	

Cartera al: 19/09/2024

Límite Máximo de VaR: 5.143 % Var Promedio: 1.166 %

Parametros: Simulación Histórica, Intervalo de Confianza del 95%, Horizonte Temporal de 1 días y con una muestra de 252 observaciones.

"El riesgo por invertir en instrumentos financieros derivados, certificados bursátiles fiduciarios y valores estructurados o respaldados por activos en caso de tenerlos en éste fondo consiste en el impacto negativo debido al movimiento en los factores que afecten directamente al subyacente adquirido a través de alguno de los instrumentos referidos; la ganancia o pérdida en estos instrumentos puede ser muy alta debido a que los factores de riesgo implícitos como movimientos de tasas de interés, tipos de cambio o inflación por mencionar algunos pueden afectar al instrumento de forma simultanea pudiendo aumentar la volatilidad de los valores, lo anterior implica que el riesgo asociado es alto."