

ESPECIALIZADO EN ACCIONES INDIZADAS AL S&P 500

| T.VALOR | EMISORA | SERIE | CALIF/BURS | VALOR TOTAL | % |
|---------|--|-------------------|------------|----------------------|----------------|
| | Chequera Dolares | | | 299,765 | 0.00% |
| CHD | 40-133 | 8036634 | | 299,765 | 0.00% |
| | Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot) | | | 7,351,066,765 | 99.98% |
| 1ISP | SPLG | * | Alta | 3,686,971,750 | 50.15% |
| 1ISP | VOO | * | Alta | 1,749,724,980 | 23.80% |
| 1ISP | BBUS | * | Alta | 833,640,575 | 11.34% |
| 1ISP | USPX | * | Alta | 606,348,146 | 8.25% |
| 1ISP | SPY | * | Alta | 354,577,642 | 4.82% |
| 1ISP | 500U | N | Alta | 119,803,672 | 1.63% |
| | Reportos | | | 1,290,450 | 0.02% |
| BI | CETES | 251016 | AAA(mex) | 1,290,450 | 0.02% |
| | TOTAL CARTERA | | | 7,352,656,980 | 100.00% |
| | ACTIVO NETO | | | 7,347,513,722 | |
| | Cartera al: | 14/11/2024 | | | |

Límite Máximo de VaR: 5.143 % Var Promedio: 1.202 %

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."