

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."