

ESPECIALIZADO EN ACCIONES INDIZADAS AL S&P 500

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Chequera Dolares			1,948,229	0.03%
CHD	40-133	8036634		1,948,229	0.03%
	Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)			5,959,735,583	99.94%
1ISP	SPLG	*	Alta	2,702,301,817	45.32%
1ISP	VOO	*	Alta	1,555,365,165	26.08%
1ISP	USPX	*	Alta	1,251,303,205	20.98%
1ISP	BBUS	*	Alta	338,614,883	5.68%
1ISP	500U	N	Alta	83,373,120	1.40%
1ISP	SPY	*	Alta	28,777,394	0.48%
	Reportos			1,545,467	0.03%
LD	BONDESD	250814	AAA(mex)	1,545,467	0.03%
	TOTAL CARTERA			5,963,229,279	100.00%
	ACTIVO NETO			5,958,649,456	
	Cartera al:	02/05/2024			

Límite Máximo de VaR: 5.143 % Var Promedio: 1.051 %

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."