

ESPECIALIZADO EN ACCIONES INDIZADAS AL S&P 500

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Chequera Dolares			1,884,284	0.03%
CHD	40-133	8036634		1,884,284	0.03%
	Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)			6,210,223,549	99.97%
1ISP	SPLG	*	Alta	2,743,862,474	44.17%
1ISP	VOO	*	Alta	1,664,909,650	26.80%
1ISP	USPX	*	Alta	1,350,425,375	21.74%
1ISP	BBUS	*	Alta	332,963,139	5.36%
1ISP	500U	N	Alta	82,475,026	1.33%
1ISP	SPY	*	Alta	35,587,885	0.57%
	Reportos			214,342	0.00%
LD	BONDESD	240425	AAA(mex)	214,342	0.00%
	TOTAL CARTERA			6,212,322,175	100.00%
	ACTIVO NETO			6,209,401,908	
	Cartera al:	11/04/2024			

Límite Máximo de VaR: 5.143 % Var Promedio: 1.040 %

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."