

ESPECIALIZADO EN ACCIONES INDIZADAS AL S&P 500

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Chequera Dolares			1,898,728	0.03%
CHD	40-133	8036634		1,898,728	0.03%
	Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)			6,234,771,088	99.74%
1ISP	SPLG	*	Alta	2,812,927,907	45.00%
1ISP	VOO	*	Alta	1,685,313,495	26.96%
1ISP	USPX	*	Alta	1,372,501,086	21.96%
1ISP	BBUS	*	Alta	243,621,451	3.90%
1ISP	500U	N	Alta	84,187,436	1.35%
1ISP	SPY	*	Alta	36,219,713	0.58%
	Reportos			14,249,135	0.23%
LD	BONDESD	250220	AAA(mex)	14,249,135	0.23%
	TOTAL CARTERA			6,250,918,951	100.00%
	ACTIVO NETO			6,241,581,260	
	Cartera al:	27/03/2024			

Límite Máximo de VaR: 5.143 % Var Promedio: 1.047 %

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."