

ESPECIALIZADO EN ACCIONES INDIZADAS AL S&P 500

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Chequera Dolares			1,955,470	0.03%
CHD	40-133	8036634		1,955,470	0.03%
	Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)			5,938,667,023	99.94%
1ISP	SPLG	*	Alta	2,682,550,014	45.14%
1ISP	VOO	*	Alta	1,561,168,406	26.27%
1ISP	USPX	*	Alta	1,249,613,706	21.03%
1ISP	BBUS	*	Alta	332,914,069	5.60%
1ISP	500U	N	Alta	83,852,889	1.41%
1ISP	SPY	*	Alta	28,567,938	0.48%
	Reportos			1,814,909	0.03%
BI	CETES	241114	AAA(mex)	1,814,909	0.03%
	TOTAL CARTERA			5,942,437,402	100.00%
	ACTIVO NETO			5,940,135,206	
	Cartera al:	18/04/2024			

Límite Máximo de VaR: 5.143 % Var Promedio: 1.044 %

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."