

ESPECIALIZADO EN ACCIONES INDIZADAS AL S&P 500

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Chequera Dolares			2,106,483	0.03%
CHD	40-133	8036634		2,106,483	0.03%
	Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)			6,859,991,222	99.92%
1ISP	SPLG	*	Alta	3,149,330,044	45.87%
1ISP	VOO	*	Alta	1,817,635,768	26.48%
1ISP	USPX	*	Alta	1,280,761,235	18.66%
1ISP	BBUS	*	Alta	502,545,215	7.32%
1ISP	500U	N	Alta	98,564,882	1.44%
1ISP	SPY	*	Alta	11,154,077	0.16%
	Reportos			3,290,522	0.05%
BI	CETES	240905	AAA(mex)	3,290,522	0.05%
	TOTAL CARTERA			6,865,388,227	100.00%
	ACTIVO NETO			6,816,840,967	
	Cartera al:	20/06/2024			

Límite Máximo de VaR: 5.143 % Var Promedio: 1.018 %

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."