

### ESPECIALIZADO EN ACCIONES INDIZADAS AL S&P 500

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>Chequera Dolares</b>			<b>1,945,578</b>	<b>0.03%</b>
CHD	40-133	8036634		1,945,578	0.03%
	<b>Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)</b>			<b>6,194,167,181</b>	<b>99.94%</b>
1ISP	SPLG	*	Alta	2,808,058,162	45.31%
1ISP	VOO	*	Alta	1,621,231,015	26.16%
1ISP	USPX	*	Alta	1,221,617,060	19.71%
1ISP	BBUS	*	Alta	447,088,739	7.21%
1ISP	500U	N	Alta	86,239,349	1.39%
1ISP	SPY	*	Alta	9,932,857	0.16%
	<b>Reportos</b>			<b>2,029,991</b>	<b>0.03%</b>
LF	BONDESF	250313	AAA(mex)	2,029,991	0.03%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>6,198,142,750</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>6,196,577,953</b>	
	<b>Cartera al:</b>	<b>31/05/2024</b>			

**Límite Máximo de VaR: 5.143 % Var Promedio: 1.033 %**

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."