

ESPECIALIZADO EN ACCIONES INDIZADAS AL S&P 500

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	Chequera Dolares			2,096,863	0.03%
CHD	40-133	8036634		2,096,863	0.03%
	Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)			6,769,256,927	99.94%
1ISP	SPLG	*	Alta	3,117,810,559	46.03%
1ISP	VOO	*	Alta	1,793,720,735	26.48%
1ISP	USPX	*	Alta	1,231,235,031	18.18%
1ISP	BBUS	*	Alta	517,199,212	7.64%
1ISP	500U	N	Alta	98,244,987	1.45%
1ISP	SPY	*	Alta	11,046,405	0.16%
	Reportos			2,258,062	0.03%
LD	BONDESD	241024	AAA(mex)	2,258,062	0.03%
	TOTAL CARTERA			6,773,611,852	100.00%
	ACTIVO NETO			6,779,777,318	
	Cartera al:	28/06/2024			

Límite Máximo de VaR: 5.143 % Var Promedio: 1.029 %

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."