

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

T.VALOR	EMISORA	SERIE	CALIF/BURS	VALOR TOTAL	%
	<b>Chequera Dolares</b>			<b>2,110,904</b>	<b>0.03%</b>
CHD	40-133	8036634		2,110,904	0.03%
	<b>Titulos Referenciados a Acciones Tracs Extranjeras (Spot)</b>			<b>6,832,368,327</b>	<b>99.82%</b>
1ISP	SPLG	*	Alta	3,150,484,126	46.03%
1ISP	VOO	*	Alta	1,819,178,017	26.58%
1ISP	USPX	*	Alta	1,242,829,735	18.16%
1ISP	BBUS	*	Alta	510,297,227	7.46%
1ISP	500U	N	Alta	98,414,825	1.44%
1ISP	SPY	*	Alta	11,164,398	0.16%
	<b>Reportos</b>			<b>10,176,282</b>	<b>0.15%</b>
BI	CETES	250306	AAA(mex)	10,176,282	0.15%
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>6,844,655,513</b>	<b>100.00%</b>
	<b>ACTIVO NETO</b>			<b>6,838,809,280</b>	
	<b>Cartera al:</b>	<b>27/06/2024</b>			

**Límite Máximo de VaR: 5.143 % Var Promedio: 1.027 %**

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."