

TIPO VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION BURSATILIDAD	VALOR RAZONABLE	% DE PART.	VAR a 1 día
<b>GUBERNAMENTAL</b>						
BI	CETES	270121	AAA(mex)	4,420,856	1.92%	1,137
<b>NA</b>						
1ISP	BLTN	N	Alta	3,465,360	1.51%	2,430
1ISP	ZAP	*	Alta	8,183,055	3.56%	83,307
<b>SERVICIOS FINANCIEROS</b>						
				<b>209,144,898</b>	<b>90.86%</b>	
1ASP	BRKB	*	Alta	3,264,107	1.42%	63,019
1ASP	GS	*	Alta	3,487,844	1.52%	87,939
1ASP	JPM	*	Alta	3,348,277	1.45%	84,405
1ASP	MS	*	Alta	2,846,702	1.24%	73,430
1ISP	ARGT	*	Alta	5,210,709	2.26%	153,218
1ISP	ASHR	*	Alta	4,218,416	1.83%	76,897
1ISP	CIBR	*	Alta	4,381,851	1.90%	103,424
1ISP	COPX	*	Alta	7,319,214	3.18%	275,272
1ISP	EWZ	*	Alta	13,178,042	5.73%	298,796
1ISP	GDX	*	Alta	3,767,040	1.64%	145,788
1ISP	GLD	*	Alta	15,464,634	6.72%	327,284
1ISP	IDTP	N	Alta	5,640,980	2.45%	63,326
1ISP	IGV	*	Alta	9,203,527	4.00%	244,298
1ISP	ILF	*	Alta	6,201,488	2.69%	117,334
1ISP	INDA	*	Alta	6,716,931	2.92%	99,674
1ISP	KWEB	*	Alta	11,907,118	5.17%	361,682
1ISP	NDUS	N	Alta	5,888,108	2.56%	104,231
1ISP	PICK	*	Alta	7,030,717	3.05%	169,799
1ISP	QQQ	*	Alta	23,175,190	10.07%	514,973
1ISP	SHY	*	Alta	19,366,896	8.41%	222,701
1ISP	TLT	*	Alta	2,222,128	0.97%	35,974
1ISP	URA	*	Alta	2,239,743	0.97%	101,244
1ISP	VJPA	N	Alta	11,472,370	4.98%	199,965
1ISP	VWCG	N	Alta	6,108,413	2.65%	86,539
1ISP	XLE	*	Alta	11,502,574	5.00%	258,194
1ISP	XLI	*	Alta	4,928,372	2.14%	79,249
1ISP	XLV	*	Alta	9,053,507	3.93%	151,460
<b>SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BASICO</b>						
1ASP	MELI	N	Alta	4,958,885	2.15%	185,556
<b>TOTAL CARTERA</b>				<b>230,173,054</b>	<b>100.00%</b>	<b>2,736,551</b>

**Características del Cálculo del VaR**

<b>Metodología:</b>	<b>Histórico</b>
<b>Nivel de confianza:</b>	<b>95.00%</b>
<b>Tamaño de la muestra:</b>	<b>500 días</b>
<b>Horizonte temporal:</b>	<b>1 día</b>
<b>Promedio de VaR Mensual:</b>	<b>2,544,799</b>
<b>Promedio % de VaR / Valor Razonable:</b>	<b>1.10%</b>
<b>Máximo % Autorizado:</b>	<b>3.00%</b>

1ISP\_VOO\_: El ETF busca replicar al S&P 500 INDEX y puede ser consultado como **VOO S&P 500 ETF**. Publicado en la página de Internet: <https://www.vanguardmexico.com/es/productos/productos-financieros/etf-de-renta-variable/VOO>

1ISP\_SHV\_: El ETF busca replicar los resultados de inversión de un Índice compuesto por bonos del tesoro de EE.UU. , puede ser consultado como **iShares Short Treasury Bond ETF**. Publicado en la página de Internet: <https://www.blackrock.com/mx/intermediarios/productos/239466/ishares-short-treasury-bond-etf>

1ISP\_XLRE\_: El ETF busca replicar los resultados de inversión del índice Real Estate Select Sector Index de EE.UU. , puede ser consultado como The Real Estate Select Sector SPDR. Publicado en la página de Internet: <https://www.ssga.com/us/en/intermediary/etfs/funds/the-real-estate-select-sector-spd-fund-xlre>

1ISP\_ACWI\_: El ETF **iShares MSCI ACWI** busca replicar los resultados de inversión de un índice compuesto por valores de renta variable de mercados desarrollados y emergentes de alta y mediana capitalización. Publicado en la página de Internet: <https://www.blackrock.com/mx/intermediarios/productos/239600/ishares-msci-acwi-etf>

1ISP\_SPY\_: El ETF busca replicar al S&P 500 INDEX y puede ser consultado como SPDR® S&P 500® ETF Trust. Publicado en la página de Internet: <https://www.ssga.com/us/en/intermediary/etfs/funds/spdr-sp-500-etf-trust-spy>

1ISP\_VT\_: El ETF busca replicar el rendimiento de un índice de referencia que mide el rendimiento de la inversión de acciones globales. Se Puede ser consultado como **VT Total World Stock ETF**. Publicado en la página de Internet: <https://www.vanguardmexico.com/es/productos/productos-financieros/etf-de-renta-variable/VT>

1ISP\_VGT\_: El ETF rata de seguir la evolución de un índice de referencia que mide el rendimiento de la inversión de los valores del sector de las tecnologías de la información. Se Puede ser consultado como **VGT Vanguard Information Technology ETF**. Publicado en la página de Internet: <https://investor.vanguard.com/investment-products/etfs/profile/vgt>