

TIPO VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION BURSATILIDAD	VALOR RAZONABLE	% DE PART.	VAR a 1 día
	<b>GUBERNAMENTAL</b>			<b>5,873,202</b>	<b>2.57%</b>	
BI	CETES	280412	AAA(mex)	5,873,202	2.57%	6,450
	<b>NA</b>			<b>12,991,296</b>	<b>5.68%</b>	
1ISP	BLTN	N	Alta	4,688,902	2.05%	14,824
1ISP	ZAP	*	Alta	8,302,394	3.63%	90,475
	<b>SERVICIOS FINANCIEROS</b>			<b>205,120,565</b>	<b>89.69%</b>	
1ASP	BRKB	*	Alta	3,126,462	1.37%	60,135
1ASP	GS	*	Alta	4,090,162	1.79%	102,740
1ASP	JPM	*	Alta	3,295,691	1.44%	80,283
1ASP	MS	*	Alta	3,480,505	1.52%	87,440
1ISP	ARGT	*	Alta	5,277,208	2.31%	149,081
1ISP	ASHR	*	Alta	4,497,046	1.97%	82,294
1ISP	COPX	*	Alta	8,173,650	3.57%	306,257
1ISP	EWZ	*	Alta	9,256,183	4.05%	216,165
1ISP	FXI	*	Alta	2,181,896	0.95%	52,408
1ISP	GDX	*	Alta	3,553,543	1.55%	137,530
1ISP	GLD	*	Alta	14,501,970	6.34%	312,636
1ISP	IGV	*	Alta	8,990,252	3.93%	253,224
1ISP	ILF	*	Alta	5,901,107	2.58%	116,221
1ISP	INDA	*	Alta	4,462,787	1.95%	70,404
1ISP	KWEB	*	Alta	10,829,698	4.74%	344,504
1ISP	NDUS	N	Alta	6,462,407	2.83%	124,796
1ISP	PICK	*	Alta	7,942,976	3.47%	195,810
1ISP	QQQ	*	Alta	30,469,639	13.32%	674,529
1ISP	SHY	*	Alta	18,673,476	8.17%	214,452
1ISP	TLT	*	Alta	2,126,534	0.93%	33,976
1ISP	URA	*	Alta	3,344,697	1.46%	150,627
1ISP	VJPA	N	Alta	12,510,501	5.47%	221,751
1ISP	VWCG	N	Alta	6,523,165	2.85%	97,040
1ISP	XLE	*	Alta	10,224,378	4.47%	240,505
1ISP	XLI	*	Alta	5,103,556	2.23%	83,495
1ISP	XLV	*	Alta	10,121,076	4.43%	168,930
	<b>SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BASICO</b>			<b>4,704,438</b>	<b>2.06%</b>	
1ASP	MELI	N	Alta	4,704,438	2.06%	177,913
	<b>TOTAL CARTERA</b>			<b>228,689,501</b>	<b>100.00%</b>	<b>2,753,920</b>

**Características del Calculo 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>2,949,506</b>
<b>Promedio % de VaR / Valor Razonable:</b>	<b>1.22%</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-spdr-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>