

TIPO VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION BURSATILIDAD	VALOR RAZONABLE	% DE PART.	VAR a 1 día
<b>GUBERNAMENTAL</b>				<b>5,454,180</b>	<b>2.34%</b>	
BI	CETES	270121	AAA(mex)	5,454,180	2.34%	931
<b>NA</b>				<b>13,393,437</b>	<b>5.74%</b>	
1ISP	BLTN	N	Alta	4,774,013	2.04%	10,040
1ISP	ZAP	*	Alta	8,619,424	3.69%	91,536
<b>SERVICIOS FINANCIEROS</b>				<b>209,661,568</b>	<b>89.78%</b>	
1ASP	BRKB	*	Alta	3,143,825	1.35%	60,582
1ASP	GS	*	Alta	3,711,545	1.59%	93,403
1ASP	JPM	*	Alta	3,474,563	1.49%	84,797
1ASP	MS	*	Alta	3,212,850	1.38%	80,866
1ISP	ARGT	*	Alta	4,957,779	2.12%	145,132
1ISP	ASHR	*	Alta	4,448,556	1.91%	80,939
1ISP	COPX	*	Alta	7,437,416	3.18%	279,189
1ISP	EWZ	*	Alta	10,309,046	4.41%	233,304
1ISP	FXI	*	Alta	2,307,211	0.99%	54,713
1ISP	GDX	*	Alta	3,531,914	1.51%	136,431
1ISP	GLD	*	Alta	14,838,668	6.35%	320,490
1ISP	IDTP	N	Alta	5,551,069	2.38%	64,497
1ISP	IGV	*	Alta	9,401,686	4.03%	267,117
1ISP	ILF	*	Alta	6,200,124	2.66%	117,086
1ISP	INDA	*	Alta	4,575,533	1.96%	67,769
1ISP	KWEB	*	Alta	11,742,720	5.03%	356,015
1ISP	NDUS	N	Alta	6,395,467	2.74%	114,353
1ISP	PICK	*	Alta	7,458,297	3.19%	184,204
1ISP	QQQ	*	Alta	27,761,787	11.89%	615,727
1ISP	SHY	*	Alta	18,853,216	8.07%	216,919
1ISP	TLT	*	Alta	2,138,820	0.92%	34,236
1ISP	URA	*	Alta	3,745,241	1.60%	166,765
1ISP	VJPA	N	Alta	12,003,258	5.14%	213,156
1ISP	VWCG	N	Alta	6,402,581	2.74%	89,809
1ISP	XLE	*	Alta	10,915,096	4.67%	252,978
1ISP	XLI	*	Alta	5,184,495	2.22%	83,210
1ISP	XLV	*	Alta	9,958,805	4.26%	166,530
<b>SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BASICO</b>				<b>5,010,415</b>	<b>2.15%</b>	
1ASP	MELI	N	Alta	5,010,415	2.15%	187,130
<b>TOTAL CARTERA</b>				<b>233,519,600</b>	<b>100.00%</b>	<b>2,893,174</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>2,774,445</b>
<b>Promedio % de VaR / Valor Razonable:</b>	<b>1.19%</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>