

TIPO VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION BURSATILIDAD	VALOR RAZONABLE	% DE PART.	VAR a 1 día
GUBERNAMENTAL				1,970,346	0.83%	
BI	CETES	261001	AAA(mex)	1,970,346	0.83%	173
NA				13,773,671	5.82%	
1ISP	BLTN	N	Alta	4,578,383	1.93%	19,807
1ISP	ZAP	*	Alta	9,195,288	3.88%	104,909
SERVICIOS FINANCIEROS				216,402,921	91.43%	
1ASP	BRKB	*	Alta	3,229,112	1.36%	61,380
1ASP	GS	*	Alta	4,378,673	1.85%	117,733
1ASP	JPM	*	Alta	3,585,364	1.51%	85,204
1ASP	MS	*	Alta	3,738,913	1.58%	93,916
1ISP	ARGT	*	Alta	5,251,212	2.22%	151,312
1ISP	ASHR	*	Alta	4,548,859	1.92%	81,784
1ISP	COPX	*	Alta	7,936,667	3.35%	298,106
1ISP	EWZ	*	Alta	8,704,894	3.68%	206,463
1ISP	FXI	*	Alta	2,994,720	1.27%	72,835
1ISP	GDX	*	Alta	4,197,169	1.77%	178,459
1ISP	GLD	*	Alta	13,475,417	5.69%	316,186
1ISP	IGV	*	Alta	7,888,263	3.33%	228,877
1ISP	ILF	*	Alta	4,796,667	2.03%	94,453
1ISP	INDA	*	Alta	4,562,098	1.93%	68,888
1ISP	KWEB	*	Alta	10,913,351	4.61%	350,769
1ISP	NDUS	N	Alta	7,667,095	3.24%	136,812
1ISP	PICK	*	Alta	8,749,609	3.70%	231,142
1ISP	QQQ	*	Alta	30,602,340	12.93%	685,589
1ISP	SHY	*	Alta	28,469,060	12.03%	326,087
1ISP	TLT	*	Alta	2,394,688	1.01%	38,254
1ISP	URA	*	Alta	3,608,425	1.52%	165,281
1ISP	VJPA	N	Alta	12,915,097	5.46%	226,856
1ISP	VWCG	N	Alta	6,548,516	2.77%	91,671
1ISP	XLE	*	Alta	9,778,592	4.13%	237,587
1ISP	XLI	*	Alta	5,339,416	2.26%	87,339
1ISP	XLV	*	Alta	10,128,704	4.28%	169,028
SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BASICO				4,542,133	1.92%	
1ASP	MELI	N	Alta	4,542,133	1.92%	173,753
TOTAL CARTERA				236,689,071	100.00%	2,990,555

Características del Calculo del VaR

Metodología:	Histórico
Nivel de confianza:	95.00%
Tamaño de la muestra:	500 días
Horizonte temporal:	1 día
Promedio de VaR Semanal:	2,975,880
Promedio % de VaR / Valor Razonable:	1.25%
Máximo % Autorizado:	3.00%

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_ACWL_*: 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>