

TIPO VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION BURSATILIDAD	VALOR RAZONABLE	% DE PART.	VAR a 1 día
GUBERNAMENTAL				4,950,929	2.15%	
BI	CETES	270902	AAA(mex)	4,950,929	2.15%	3,298
NA				11,743,626	5.10%	
1ISP	BLTN	N	Alta	3,497,526	1.52%	2,950
1ISP	ZAP	*	Alta	8,246,100	3.58%	83,574
SERVICIOS FINANCIEROS				208,599,927	90.59%	
1ASP	BRKB	*	Alta	3,201,044	1.39%	61,525
1ASP	GS	*	Alta	3,608,685	1.57%	90,580
1ASP	JPM	*	Alta	3,421,249	1.49%	85,859
1ASP	MS	*	Alta	2,984,865	1.30%	74,934
1ISP	ARGT	*	Alta	5,079,835	2.21%	148,321
1ISP	ASHR	*	Alta	4,182,144	1.82%	75,895
1ISP	COPX	*	Alta	7,572,789	3.29%	283,537
1ISP	EWZ	*	Alta	12,757,013	5.54%	287,958
1ISP	GDX	*	Alta	3,910,183	1.70%	150,652
1ISP	GLD	*	Alta	15,243,563	6.62%	328,385
1ISP	IDTP	N	Alta	5,489,212	2.38%	63,614
1ISP	IGV	*	Alta	8,534,375	3.71%	229,015
1ISP	ILF	*	Alta	6,310,850	2.74%	118,870
1ISP	INDA	*	Alta	6,815,430	2.96%	100,684
1ISP	KWEB	*	Alta	11,678,705	5.07%	353,160
1ISP	NDUS	N	Alta	6,303,846	2.74%	111,092
1ISP	PICK	*	Alta	7,325,846	3.18%	176,137
1ISP	QQQ	*	Alta	28,391,421	12.33%	628,065
1ISP	SHY	*	Alta	18,728,326	8.13%	214,925
1ISP	TLT	*	Alta	2,152,496	0.93%	34,366
1ISP	URA	*	Alta	2,281,291	0.99%	102,662
1ISP	VJPA	N	Alta	11,846,949	5.14%	209,837
1ISP	VWCG	N	Alta	6,340,086	2.75%	88,703
1ISP	XLE	*	Alta	10,426,132	4.53%	240,768
1ISP	XLI	*	Alta	5,082,110	2.21%	81,356
1ISP	XLV	*	Alta	8,931,482	3.88%	148,752
SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BASICO				4,981,237	2.16%	
1ASP	MELI	N	Alta	4,981,237	2.16%	185,560
TOTAL CARTERA				230,275,719	100.00%	2,679,067

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:	2,689,989
Promedio % de VaR / Valor Razonable:	1.17%
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>