

TIPO VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION BURSATILIDAD	VALOR RAZONABLE	% DE PART.	VAR a 1 día
	GUBERNAMENTAL			5,260,951	2.24%	
BI	CETES	270121	AAA(mex)	5,260,951	2.24%	775
	NA			13,030,323	5.55%	
1ISP	BLTN	N	Alta	4,699,948	2.00%	14,854
1ISP	ZAP	*	Alta	8,330,375	3.55%	90,751
	SERVICIOS FINANCIEROS			211,621,036	90.20%	
1ASP	BRKB	*	Alta	3,141,534	1.34%	60,406
1ASP	GS	*	Alta	4,016,108	1.71%	100,848
1ASP	JPM	*	Alta	3,262,818	1.39%	79,457
1ASP	MS	*	Alta	3,405,397	1.45%	85,526
1ISP	ARGT	*	Alta	5,180,993	2.21%	149,266
1ISP	ASHR	*	Alta	4,489,651	1.91%	82,133
1ISP	COPX	*	Alta	8,190,261	3.49%	306,782
1ISP	EWZ	*	Alta	9,295,013	3.96%	217,003
1ISP	FXI	*	Alta	2,175,184	0.93%	52,230
1ISP	GDV	*	Alta	3,457,084	1.47%	133,754
1ISP	GLD	*	Alta	14,331,119	6.11%	308,855
1ISP	IDTP	N	Alta	5,514,356	2.35%	63,931
1ISP	IGV	*	Alta	10,626,928	4.53%	299,229
1ISP	ILF	*	Alta	5,920,027	2.52%	116,556
1ISP	INDA	*	Alta	4,468,618	1.90%	70,473
1ISP	KWEB	*	Alta	10,786,574	4.60%	343,023
1ISP	NDUS	N	Alta	6,419,380	2.74%	123,926
1ISP	PICK	*	Alta	7,951,323	3.39%	195,953
1ISP	QQQ	*	Alta	30,316,306	12.92%	670,922
1ISP	SHY	*	Alta	18,638,890	7.94%	213,987
1ISP	TLT	*	Alta	2,123,133	0.90%	33,911
1ISP	URA	*	Alta	3,339,468	1.42%	150,344
1ISP	VJPA	N	Alta	12,434,569	5.30%	220,335
1ISP	VWCG	N	Alta	6,487,291	2.77%	96,476
1ISP	XLE	*	Alta	10,330,120	4.40%	242,916
1ISP	XLI	*	Alta	5,116,304	2.18%	83,677
1ISP	XLV	*	Alta	10,202,587	4.35%	170,236
	SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BASICO			4,697,676	2.00%	
1ASP	MELI	N	Alta	4,697,676	2.00%	177,601
	TOTAL CARTERA			234,609,986	100.00%	2,873,032

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:	2,869,702
Promedio % de VaR / Valor Razonable:	1.22%
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-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>