

TIPO VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION BURSATILIDAD	VALOR RAZONABLE	% DE PART.	VAR a 1 día
GUBERNAMENTAL				5,721,067	2.48%	
BI	CETES	270121	AAA(mex)	5,721,067	2.48%	1,047
NA				13,164,291	5.70%	
1ISP	BLTN	N	Alta	4,762,454	2.06%	9,970
1ISP	ZAP	*	Alta	8,401,837	3.64%	88,817
SERVICIOS FINANCIEROS				207,272,923	89.68%	
1ASP	BRKB	*	Alta	3,167,094	1.37%	60,750
1ASP	GS	*	Alta	3,651,747	1.58%	91,477
1ASP	JPM	*	Alta	3,442,864	1.49%	83,639
1ASP	MS	*	Alta	3,165,127	1.37%	79,299
1ISP	ARGT	*	Alta	4,940,820	2.14%	143,972
1ISP	ASHR	*	Alta	4,395,177	1.90%	79,601
1ISP	COPX	*	Alta	7,288,136	3.15%	272,332
1ISP	EWZ	*	Alta	10,072,814	4.36%	226,913
1ISP	FXI	*	Alta	2,287,261	0.99%	53,991
1ISP	GDV	*	Alta	3,461,624	1.50%	133,103
1ISP	GLD	*	Alta	14,672,822	6.35%	315,455
1ISP	IDTP	N	Alta	5,577,685	2.41%	64,509
1ISP	IGV	*	Alta	9,502,154	4.11%	268,734
1ISP	ILF	*	Alta	6,089,431	2.63%	114,469
1ISP	INDA	*	Alta	4,555,900	1.97%	67,169
1ISP	KWEB	*	Alta	11,474,012	4.96%	346,274
1ISP	NDUS	N	Alta	6,258,424	2.71%	111,389
1ISP	PICK	*	Alta	7,298,232	3.16%	179,424
1ISP	QQQ	*	Alta	27,605,091	11.94%	609,445
1ISP	SHY	*	Alta	18,900,994	8.18%	216,472
1ISP	TLT	*	Alta	2,148,589	0.93%	34,235
1ISP	URA	*	Alta	3,523,657	1.52%	156,180
1ISP	VJPA	N	Alta	11,796,646	5.10%	208,527
1ISP	VWCG	N	Alta	6,311,767	2.73%	88,130
1ISP	XLE	*	Alta	10,840,847	4.69%	250,106
1ISP	XLI	*	Alta	5,064,719	2.19%	80,915
1ISP	XLV	*	Alta	9,779,289	4.23%	162,779
SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BASICO				4,956,760	2.14%	
1ASP	MELI	N	Alta	4,956,760	2.14%	184,278
TOTAL CARTERA				231,115,041	100.00%	2,821,368

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:	2,835,193
Promedio % de VaR / Valor Razonable:	1.23%
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>