

INVEXTK

CLASIFICACION: ESPECIALIZADA EN ACCIONES A TRAVES DE TRAKERS DEL SIC

COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES

DEL DÍA 31/05/2022

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION/ BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
---------------	---------	-------	-------------------------------	-------------------	---

SERVICIOS

1I	EWG	*	ALTB	16,974,048.76	2.04
1I	EWL	*	ALTB	16,498,811.26	1.98
1I	EWN	*	ALTB	67,116,691.16	8.07
1I	EWO	*	ALTB	17,766,675.57	2.13
1I	EWQ	*	ALTB	88,486,617.78	10.64
1I	EWT	*	ALTB	34,540,079.87	4.15
1I	ITOT	*	ALTB	38,911,831.78	4.68
1I	IW	*	ALTB	490,913,764.67	59.15
1I	KSA	*	ALTB	27,252,448.72	3.27
1I	QAT	*	ALTB	15,079,112.69	1.81
1I	UAE	*	ALTB	16,086,695.32	1.93

REPORTOS

IS	BPAG91	230427	mxAAA	1,324,167.91	0.15
----	--------	--------	-------	--------------	------

CARTERA TOTAL:

830,950,945.49 **100.00%**

VAR ESTABLECIDO:

3.500%

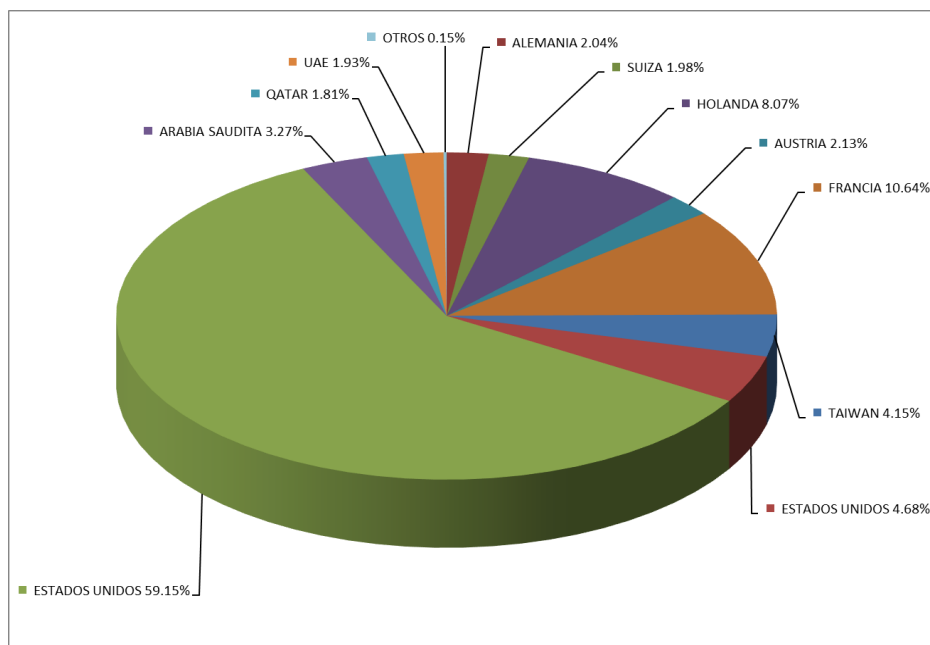
VAR OBSERVADO PROMEDIO:

1.9621%

Valor en Riesgo (VaR)

METODOLOGIA: Corresponde a estimar la perdida que puede afrontar un portafolio por variaciones en los factores de riesgo, dado un nivel de confianza y un horizonte de tiempo.

PARAMETROS: Método Histórico ponderado exponencialmente, nivel de confianza del 95% y horizonte 1



Principales países donde se encuentran invertidos los mecanismos de inversion.