

CLASIFICACION: ESPECIALIZADA EN DEUDA
COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES
DEL DIA 27/01/2022

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
Servicios					
1I	FLOA	N	ALTB	72,535,968.74	10.41%
1I	IB01	N	ALTB	397,638,558.13	57.15%
1I	SDIA	N	ALTB	41,582,699.43	5.97%
1I	STYC	N	ALTB	18,048,364.65	2.59%
1I	VDST	N	ALTB	149,279,827.74	21.44%
1I	VOO	*	ALTB	4,222,363.00	0.60%
				683,307,781.69	
				683,307,781.69	
Reportos					
IQ	BPAG91	260903	mxAAA	12,860,183.19	1.84%
				12,860,183.19	
				12,860,183.19	
CARTERA TOTAL:				696,167,964.88	100.00%
VaR ESTABLECIDO:			2.000 %		
VaR OBSERVADO PROMEDIO:			0.9911 %		

Valor en Riesgo (VaR)

METODOLOGIA: Corresponde a estimar la pérdida 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 día.

Esta información se actualiza el último día hábil de cada semana.