

CLASIFICACION: ESPECIALIZADA EN RENTA VARIABLE
COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES
DEL DIA 26/02/2021

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
Industriales					
1	ACCELSA	B	MINB	9,815,094.00	30.10%
				9,815,094.00	
				9,815,094.00	
Comerciales					
1	SORIANA	B	MEDB	2,328,753.24	7.13%
				2,328,753.24	
				2,328,753.24	
Servicios					
1	GAP	B	ALTB	4,232,800.00	12.97%
				4,232,800.00	
1B	NAFTRAC	ISHRS	ALTB	9,327,202.43	28.58%
				9,327,202.43	
				13,560,002.43	
Comunicaciones y Transportes					
1	AMX	L	ALTB	919,009.26	2.81%
				919,009.26	
				919,009.26	
Reportos					
IQ	BPAG91	211223	mxAAA	6,010,551.52	18.41%
				6,010,551.52	
				6,010,551.52	
CARTERA TOTAL:				32,633,410.45	100.00%
VaR ESTABLECIDO:			4.500 %		
VaR OBSERVADO PROMEDIO:			1.1485 %		

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.