

CLASIFICACION: ESPECIALIZADA EN DEUDA
COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES
DEL DIA 31/12/2021

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
Servicios					
1I	FLOA	N	ALTB	71,540,016.36	11.53%
1I	IB01	N	ALTB	284,393,337.57	45.92%
1I	SDIA	N	ALTB	47,652,383.62	7.68%
1I	STYC	N	ALTB	18,036,907.34	2.90%
1I	VDST	N	ALTB	122,396,828.47	19.73%
1I	VOO	*	ALTB	4,583,915.15	0.73%
1I	VTIP	*	ALTB	61,442,643.80	9.90%
				610,046,032.31	
				610,046,032.31	
Reportos					
IQ	BPAG91	260507	mxAAA	10,009,223.94	1.61%
				10,009,223.94	
				10,009,223.94	
				620,055,256.25	100.00%

CARTERA TOTAL:

VaR ESTABLECIDO:

2.000 %

VaR OBSERVADO PROMEDIO:

1.0162 %

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.