

CLASIFICACION: ESPECIALIZADO EN RENTA VARIABLE
COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES
DEL DIA 31/12/2021

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
Servicios					
1I	IYC	*	ALTB	17,787,877.38	2.93%
1I	IYW	*	ALTB	128,751,063.81	21.34%
1I	SOXX	*	ALTB	47,633,930.15	7.86%
1I	VFH	*	ALTB	77,550,846.80	12.80%
1I	VIS	*	ALTB	38,308,909.05	6.32%
1I	VOO	*	ALTB	90,908,348.48	15.01%
1I	XLB	*	ALTB	6,152,449.13	1.01%
1I	XLC	*	ALTB	20,307,852.10	3.35%
1I	XLE	*	ALTB	22,300,091.34	3.68%
1I	XLRE	*	ALTB	32,427,303.91	5.35%
1I	XLV	*	ALTB	58,098,078.08	9.59%
1I	XLY	*	ALTB	49,446,973.62	8.16%
				589,673,723.85	
				589,673,723.85	
Reportos					
IQ	BPAG91	260507	mxAAA	15,770,530.85	2.60%
				15,770,530.85	
				15,770,530.85	
CARTERA TOTAL:				605,444,254.70	100.00%
VaR ESTABLECIDO:			6.000 %		
VaR OBSERVADO PROMEDIO:			1.3440 %		

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.