

**CLASIFICACION: INDEFINIDO**  
**COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES**  
**DEL DIA 28/06/2019**

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
<b>Industriales</b>					
1	ACCELSA	B	BAJB	13,906,876.50	14.08%
1	ALEATIC	*	MEDB	14,306,829.79	14.48%
1	GPROFUT	*	MINB	1,301,580.00	1.31%
				<u>29,515,286.29</u>	
				<u>29,515,286.29</u>	
<b>Comerciales</b>					
1	GFAMSA	A	BAJB	19,183,500.00	19.42%
				<u>19,183,500.00</u>	
				<u>19,183,500.00</u>	
<b>Comunicaciones y Transportes</b>					
1A	UTSI	*	ALTB	37,819,837.44	38.34%
				<u>37,819,837.44</u>	
				<u>37,819,837.44</u>	
<b>Reportos</b>					
IQ	BPAG91	240111	mxAAA	12,220,233.55	12.37%
				<u>12,220,233.55</u>	
				<u>12,220,233.55</u>	
<b>CARTERA TOTAL:</b>				<b>98,738,857.28</b>	<b>100.00%</b>
<b>VaR ESTABLECIDO:</b>			<b>4.500 %</b>		
<b>VaR OBSERVADO PROMEDIO:</b>			<b>1.3008 %</b>		

**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, nivel de confianza del 95% y horizonte 1 día.

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