

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	%
Servicios					
1I	FDN	*	ALTB	65,587,468.62	16.74%
1I	IHE	*	ALTB	14,660,074.95	3.72%
1I	IYC	*	ALTB	60,394,181.79	15.35%
1I	IYT	*	ALTB	21,230,309.26	5.39%
1I	PBW	*	ALTB	14,925,520.81	3.79%
1I	VFH	*	ALTB	28,705,503.83	7.29%
1I	VGT	*	ALTB	48,680,959.83	12.37%
1I	VHT	*	ALTB	14,924,767.18	3.79%
1I	VIS	*	ALTB	25,036,895.48	6.36%
1I	VOO	*	ALTB	63,830,361.40	16.22%
1I	XBI	*	ALTB	16,024,055.90	4.07%
1I	XME	*	ALTB	11,448,822.60	2.91%
				<u>385,448,921.65</u>	
				<u>385,448,921.65</u>	

Reportos

IQ	BPAG91	211223	mxAAA	7,899,104.55	2.00%
				<u>7,899,104.55</u>	
				<u>7,899,104.55</u>	
CARTERA TOTAL:				393,348,026.20	100.00%

VaR ESTABLECIDO: 6.000 %

VaR OBSERVADO PROMEDIO: 1.9200 %

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.