

CLASIFICACION: ESPECIALIZADO EN RENTA VARIABLE
COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES
DEL DIA 29/07/2022

| TIPO DE VALOR | EMISORA | SERIE | CALIFICACION / BURSATILIDAD | IMPORTE A MERCADO | % |
|--------------------------------|---------|--------|-----------------------------|-----------------------|----------------|
| Servicios | | | | | |
| 1I | CIBR | * | ALTB | 13,887,747.69 | 2.80% |
| 1I | IYW | * | ALTB | 82,669,738.96 | 16.75% |
| 1I | SOXX | * | ALTB | 25,081,956.72 | 5.06% |
| 1I | VFH | * | ALTB | 51,446,481.13 | 10.39% |
| 1I | VOO | * | ALTB | 75,172,352.63 | 15.18% |
| 1I | XLB | * | ALTB | 5,181,658.81 | 1.04% |
| 1I | XLC | * | ALTB | 14,287,161.52 | 2.88% |
| 1I | XLE | * | ALTB | 28,604,107.00 | 5.77% |
| 1I | XLI | * | ALTB | 27,580,198.50 | 5.57% |
| 1I | XLP | * | ALTB | 33,841,549.56 | 6.83% |
| 1I | XLRE | * | ALTB | 10,742,438.68 | 2.16% |
| 1I | XLU | * | ALTB | 20,503,167.10 | 4.14% |
| 1I | XLV | * | ALTB | 66,356,850.81 | 13.40% |
| 1I | XLY | * | ALTB | 38,325,507.70 | 7.74% |
| | | | | 493,680,916.81 | |
| | | | | 493,680,916.81 | |
| Reportos | | | | | |
| IM | BPAG28 | 241107 | mxAAA | 1,441,391.43 | 0.29% |
| | | | | 1,441,391.43 | |
| | | | | 1,441,391.43 | |
| CARTERA TOTAL: | | | | 495,122,308.24 | 100.00% |
| VaR ESTABLECIDO: | | | 6.000 % | | |
| VaR OBSERVADO PROMEDIO: | | | 1.9459 % | | |

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.