

CLASIFICACION: ESPECIALIZADA EN ACCIONES A TRAVES DE TRACKERS DEL SIC
COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES
DEL DIA 27/01/2022

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
Servicios					
1I	EPU	*	ALTB	26,517,591.05	2.70%
1I	EWC	*	ALTB	32,854,027.56	3.35%
1I	EWG	*	ALTB	43,584,354.49	4.44%
1I	EWL	*	ALTB	39,618,936.77	4.04%
1I	EWN	*	ALTB	119,596,354.12	12.20%
1I	EWQ	*	ALTB	29,983,098.70	3.06%
1I	EWY	*	ALTB	34,256,612.09	3.49%
1I	ITOT	*	ALTB	66,666,584.23	6.80%
1I	IVV	*	ALTB	577,887,910.84	59.05%
				<u>970,965,469.85</u>	
				<u>970,965,469.85</u>	
Reportos					
IQ	BPAG91	260903	mxAAA	8,609,891.29	0.87%
				<u>8,609,891.29</u>	
				<u>8,609,891.29</u>	
CARTERA TOTAL:				979,575,361.14	100.00%
VaR ESTABLECIDO:			3.500 %		
VaR OBSERVADO PROMEDIO:			1.2262 %		

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.