

CLASIFICACION: ESPECIALIZADO EN RENTA VARIABLE
COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES
DEL DIA 11/08/2022

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
Servicios					
1I	CIBR	*	ALTB	14,634,386.90	2.96%
1I	IYW	*	ALTB	83,676,587.88	17.02%
1I	SOXX	*	ALTB	24,734,207.17	5.00%
1I	VFH	*	ALTB	52,445,008.92	10.61%
1I	VOO	*	ALTB	75,104,828.62	15.20%
1I	XLB	*	ALTB	5,176,385.09	1.04%
1I	XLC	*	ALTB	14,539,706.94	2.94%
1I	XLE	*	ALTB	27,847,160.30	5.63%
1I	XLI	*	ALTB	27,805,439.00	5.63%
1I	XLP	*	ALTB	33,339,225.38	6.75%
1I	XLRE	*	ALTB	10,635,176.45	2.15%
1I	XLU	*	ALTB	20,517,555.37	4.15%
1I	XLV	*	ALTB	64,817,870.71	13.12%
1I	XLY	*	ALTB	38,336,040.52	7.76%
				493,609,579.25	
				493,609,579.25	
Reportos					
IQ	BPAG91	260507	mxAAA	243,442.73	0.04%
				243,442.73	
				243,442.73	
CARTERA TOTAL:				493,853,021.98	100.00%
VaR ESTABLECIDO:			6.000 %		
VaR OBSERVADO PROMEDIO:			1.9196 %		

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.