

CLASIFICACION: ESPECIALIZADA EN RENTA VARIABLE
COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES
DEL DIA 04/03/2021

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
Servicios					
11	FDN	*	ALTB	62,407,277.94	16.14%
11	IHE	*	ALTB	14,185,192.36	3.66%
11	IYC	*	ALTB	59,826,038.66	15.47%
11	IYT	*	ALTB	21,208,777.58	5.48%
11	PBW	*	ALTB	13,361,238.60	3.45%
11	VFH	*	ALTB	29,616,735.33	7.66%
11	VGT	*	ALTB	47,219,572.35	12.21%
11	VHT	*	ALTB	14,623,525.57	3.78%
11	VIS	*	ALTB	25,296,584.16	6.54%
11	VOO	*	ALTB	63,780,695.71	16.57%
11	XBI	*	ALTB	14,789,173.77	3.82%
11	XME	*	ALTB	11,827,413.12	3.05%
				<u>378,142,225.15</u>	
				<u>378,142,225.15</u>	
Reportos					
LD	BONDES	240425	mxAAA	8,420,182.11	2.17%
				<u>8,420,182.11</u>	
				<u>8,420,182.11</u>	
CARTERA TOTAL:				386,562,407.26	100.00%
VaR ESTABLECIDO:			6.000 %		
VaR OBSERVADO PROMEDIO:			1.8804 %		

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.