

CLASIFICACION: ESPECIALIZADA EN ACCIONES A TRAVES DE TRACKERS DEL SIC
COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES
DEL DIA 11/08/2022

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
Servicios					
1I	EDEN	*	ALTB	18,536,369.54	2.39%
1I	EWL	*	ALTB	44,120,245.35	5.69%
1I	EWN	*	ALTB	60,360,327.35	7.79%
1I	EWO	*	ALTB	15,436,227.51	1.99%
1I	EWQ	*	ALTB	70,489,306.54	9.10%
1I	EWT	*	ALTB	11,534,252.06	1.48%
1I	EWU	*	ALTB	52,643,273.54	6.79%
1I	EZA	*	ALTB	3,779,373.76	0.48%
1I	ITOT	*	ALTB	28,512,780.09	3.68%
1I	IVV	*	ALTB	459,270,700.97	59.38%
1I	KSA	*	ALTB	7,691,374.53	0.99%
				<u>772,374,231.24</u>	
				<u>772,374,231.24</u>	
Reportos					
IQ	BPAG91	260507	mxAAA	1,913,334.16	0.24%
				<u>1,913,334.16</u>	
				<u>1,913,334.16</u>	
CARTERA TOTAL:				774,287,565.40	100.00%
VaR ESTABLECIDO:			3.500 %		
VaR OBSERVADO PROMEDIO:			1.9600 %		

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.