

**CLASIFICACION: ESPACIALIZADA EN ACCIONES A TRAVES DE TRACKERS DEL SIC**  
**COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES**  
**DEL DIA 04/03/2021**

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
<b>Servicios</b>					
1I	ACWI	*	ALTB	214,262,106.07	24.63%
1I	EPU	*	ALTB	71,380,388.01	8.20%
1I	ERUS	*	ALTB	34,674,593.18	3.98%
1I	EWM	*	ALTB	96,321,645.72	11.07%
1I	EWT	*	ALTB	105,027,454.66	12.07%
1I	EWZ	*	ALTB	31,629,447.65	3.63%
1I	IVV	*	ALTB	283,004,560.53	32.60%
1I	TUR	*	ALTB	25,196,349.67	2.89%
				861,496,545.49	
				861,496,545.49	
<b>Reportos</b>					
LD	BONDES	240425	mxAAA	8,143,073.29	0.93%
				8,143,073.29	
				8,143,073.29	
<b>CARTERA TOTAL:</b>				<b>869,639,618.78</b>	<b>100.00%</b>
<b>VaR ESTABLECIDO:</b>			<b>3.500 %</b>		
<b>VaR OBSERVADO PROMEDIO:</b>			<b>1.4339 %</b>		

**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.