

CLASIFICACION: INDEFINIDO
COMPOSICION DE LA CARTERA DE VALORES
DEL DIA 28/06/2019

TIPO DE VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION / BURSATILIDAD	IMPORTE A MERCADO	%
Industriales					
1	ACCELSA	B	BAJB	13,906,876.50	14.08%
1	ALEATIC	*	MEDB	14,306,829.79	14.48%
1	GPROFUT	*	MINB	1,301,580.00	1.31%
				29,515,286.29	
				29,515,286.29	
Comerciales					
1	GFAMSA	A	BAJB	19,183,500.00	19.42%
				19,183,500.00	
				19,183,500.00	
Comunicaciones y Transportes					
1A	UTSI	*	ALTB	37,819,837.44	38.34%
				37,819,837.44	
				37,819,837.44	
Reportos					
IQ	BPAG91	240111	mxAAA	12,220,233.55	12.37%
				12,220,233.55	
				12,220,233.55	
CARTERA TOTAL:				98,738,857.28	100.00%
VaR ESTABLECIDO:			4.500 %		
VaR OBSERVADO PROMEDIO:			1.3008 %		

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, nivel de confianza del 95% y horizonte 1 día.

Esta información se actualiza el último día hábil de cada semana.