

TIPO VALOR	EMISORA	SERIE	CALIFICACION BURSATILIDAD	VALOR RAZONABLE	% DE PART.	VAR a 1 día
SERVICIOS FINANCIEROS				452,190,923	92.87%	
1ISP	ACWI	*	Alta	383,007,285	78.66%	5,715,545
1ISP	CIBR	*	Alta	6,615,879	1.36%	164,677
1ISP	EFG	*	Alta	9,529,399	1.96%	153,138
1ISP	GRID	*	Alta	3,983,945	0.82%	84,776
1ISP	IGV	*	Alta	10,158,985	2.09%	286,143
1ISP	ILF	*	Alta	9,306,057	1.91%	183,280
1ISP	SMH	*	Alta	7,560,648	1.55%	279,614
1ISP	TDIV1	N	Alta	11,107,589	2.28%	123,169
51	FMXRF	XF0	AAA/1	10,921,136	2.24%	
SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BASICO				24,777,762	5.09%	
1ASP	AMZN	*	Alta	7,400,742	1.52%	221,216
1ASP	MELI	N	Alta	17,377,020	3.57%	657,165
TECNOLOGIA DE LA INFORMACION				9,940,110	2.04%	
1ASP	CRM	*	Alta	4,321,056	0.89%	162,523
1ASP	GOOGL	*	Alta	5,619,054	1.15%	164,911
TOTAL CARTERA				486,908,795	100.00%	7,240,027

Características del Calculo del VaR

Metodología:	Histórico
Nivel de confianza:	95.00%
Tamaño de la muestra:	500 días
Horizonte temporal:	1 día
Promedio de VaR Mensual:	7,330,711
Promedio % de VaR / Valor Razonable:	1.50%
Máximo % Autorizado:	3.00%