

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Valor Razonable	%
DIRECTO					
CHEQUERAS BANCARIAS EN DÓLARES					
CHD	JPMOR	7819175		486,543,792.00	4.46
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)					
1ISP	VDST	N	ALTA	2,518,655,764.68	23.07
1ISP	BIL	*	ALTA	2,196,370,885.88	20.12
1ISP	FLOA	N	ALTA	1,122,303,228.63	10.28
1ISP	ERNA	N	ALTA	1,114,181,169.76	10.21
1ISP	USFR	*	ALTA	1,058,802,708.66	9.70
1ISP	TFRN	N	ALTA	1,040,004,033.41	9.53
1ISP	TI5A	N	ALTA	222,629,377.63	2.04
TREASURY BILLS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)					
D4SP	TBILT22	260811	AA+	536,932,341.41	4.92
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO				10,296,423,302.06	94.32
PRESTAMO DE VALORES					
1ISP	VDST	N	ALTA	257,274,831.25	2.36
OTROS VALORES				363,060,339.47	3.33
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES				10,916,758,472.78	100.00
TOTAL PRESTAMO DE VALORES				257,274,831.25	2.36

CATEGORÍA
RVDIS

CALIFICACIÓN

VaR Promedio última semana
0.781%

Límite de VaR
2.400%

Para llevar a cabo la estimación del Valor en Riesgo (VaR) de mercado para las Fondos de Inversión administrados por Operadora GBM, se acordó con la empresa Valor de Mercado (Valmer) que sea ella quien lo realice, siguiendo los criterios metodológicos aprobados por la Unidad de Administración Integral de riesgos de la Operadora.
El método utilizado para la estimación del VaR es el conocido como simulación histórica, con los parámetros que se presentan a continuación:

- Un periodo de muestra de un año
- El nivel de confianza para el VaR fijado al 95%
- El horizonte temporal para el que se estime la posible minusvalía será de 1 día

Composición de las Carteras de los Fondos Origen

