

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Valor Razonable	%
DIRECTO					
CHEQUERAS BANCARIAS EN DÓLARES					
CHD	JPMOR	7819175		1,249,596,758.92	10.80
TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES (TIPO DE CAMBIO CIERRE)					
JISP	CABEI	270125	Aa2	343,074,497.36	2.97
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)					
1ISP	VDST	N	ALTA	2,478,855,598.03	21.43
1ISP	BIL	*	ALTA	2,070,233,290.73	17.90
1ISP	FLOA	N	ALTA	1,105,793,291.28	9.56
1ISP	ERNA	N	ALTA	1,097,530,682.10	9.49
1ISP	USFR	*	ALTA	1,042,149,904.02	9.01
1ISP	TFRN	N	ALTA	1,023,310,481.73	8.85
1ISP				239,407,265.08	2.07
TREASURY BILLS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)					
D4SP	TBILB05	260908	AA+	254,996,436.90	2.20
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO				10,904,948,206.15	94.29
PRESTAMO DE VALORES					
1ISP	VDST	N	ALTA	253,209,336.75	2.19
OTROS VALORES				406,985,493.03	3.52
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES				11,565,143,035.93	100.00
TOTAL PRESTAMO DE VALORES				253,209,336.75	2.19

CATEGORÍA
RVDIS

CALIFICACIÓN

VaR Promedio última semana
0.771%

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

