

GBMfondos

GBMDOL GBM FONDO DE INVERSION EN DOLARES, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 27 JUNIO, 2024

| Tipo Valor | Emisora | Serie | Calif. / Bursatilidad | Cant. Títulos | Valor Razonable | Participación Porcentual |
|--|---------|---------|-----------------------|---------------|-------------------------|--------------------------|
| DIRECTO | | | | | | |
| CHEQUERAS BANCARIAS EN DÓLARES | | | | | | |
| CHD | JPMOR | 7819175 | | 3,285,851 | 60,488,564.62 | 2.20 |
| EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS (TIPO DE CAMBIO CIERRE) | | | | | | |
| D2SP | LIVEE96 | 241002 | BBB | 3,050 | 56,321,159.72 | 2.05 |
| OTROS TIPO DE VALOR D2SP - EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS (TIPO DE CAMBIO CIERRE) | | | | | | |
| | | | | 7,701 | 141,274,450.61 | 5.14 |
| TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES (TIPO DE CAMBIO CIERRE) | | | | | | |
| JISP | CABE251 | 250506 | Aa3 | 6,600 | 118,308,602.13 | 4.30 |
| TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE) | | | | | | |
| 1ISP | TFRN | N | ALTA | 786,461 | 812,421,929.76 | 29.55 |
| 1ISP | FLOA | N | ALTA | 3,786,957 | 415,142,904.10 | 15.10 |
| 1ISP | IB01 | N | ALTA | 203,014 | 414,834,097.68 | 15.09 |
| 1ISP | ERNA | N | ALTA | 2,323,924 | 248,812,273.26 | 9.05 |
| 1ISP | VDCA | N | ALTA | 184,750 | 189,947,290.93 | 6.91 |
| 1ISP | BIL | * | ALTA | 67,815 | 114,540,036.83 | 4.17 |
| TREASURY BILLS (TIPO DE CAMBIO CIERRE) | | | | | | |
| D4SP | TBILH93 | 240702 | AA+ | 85,000 | 156,382,669.18 | 5.69 |
| TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO | | | | | 2,728,473,978.82 | 99.24 |
| OTROS VALORES | | | | 5,890,268 | 20,822,885.33 | 0.76 |
| TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES | | | | | 2,749,296,864.15 | 100.00 |

| | | |
|---------------------|---------------------|----------------------|
| | CATEGORÍA | |
| | RVDIS | |
| CALIFICACIÓN | VaR Promedio | Limite de VaR |
| | 0.940% | 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

Lic. Julio Andres Maza Casas