

GBMfondos

GBMDOL GBM FONDO DE INVERSION EN DOLARES, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 28 JUNIO, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
D2SP	LIVEE96	241002	BBB	3,050	55,976,478.04	2.05
OTROS TIPO DE VALOR D2SP - EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)				7,701	140,575,472.29	5.16
TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
JISP	CABE251	250506	Aa3	6,600	117,566,825.05	4.31
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	TFRN	N	ALTA	786,461	807,227,035.55	29.62
1ISP	FLOA	N	ALTA	3,786,957	412,239,614.58	15.13
1ISP	IB01	N	ALTA	203,014	412,145,608.45	15.12
1ISP	ERNA	N	ALTA	2,323,924	247,070,227.29	9.07
1ISP	VDCA	N	ALTA	184,750	189,020,106.43	6.94
1ISP	BIL	*	ALTA	67,815	113,814,418.77	4.18
TREASURY BILLS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
D4SP	TBILH93	240702	AA+	85,000	155,409,910.48	5.70
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					2,651,045,696.93	97.27
OTROS VALORES				8,783,661	74,311,948.14	2.73
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					2,725,357,645.07	100.00

	CATEGORÍA	
	RVDIS	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Limite de VaR
	0.942%	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