

# GBMfondos

GBMDOL GBM FONDO DE INVERSION EN DOLARES, S.A. DE C.V., F.I.R.V.  
CARTERA DE VALORES AL 25 JULIO, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
<b>DIRECTO</b>						
<b>EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)</b>						
D2SP	LIVEE96	241002	BBB	3,050	56,691,762.01	2.03
OTROS TIPO DE VALOR D2SP - EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)				7,701	141,846,226.58	5.09
<b>TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES (TIPO DE CAMBIO CIERRE)</b>						
JISP	CABE251	250506	Aa3	6,600	119,166,816.58	4.27
<b>TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)</b>						
1ISP	TFRN	N	ALTA	786,461	817,321,075.30	29.31
1ISP	FLOA	N	ALTA	3,786,957	418,012,860.82	14.99
1ISP	IB01	N	ALTA	203,014	417,689,652.00	14.98
1ISP	BIL	*	ALTA	183,089	309,869,733.84	11.11
1ISP	ERNA	N	ALTA	2,323,924	250,645,145.15	8.99
1ISP	VDCA	N	ALTA	184,750	192,340,344.38	6.90
<b>TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO</b>					<b>2,723,583,616.66</b>	<b>97.68</b>
<b>OTROS VALORES</b>				8,280,839	<b>64,702,731.12</b>	<b>2.32</b>
<b>TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES</b>					<b>2,788,286,347.78</b>	<b>100.00</b>

	<b>CATEGORÍA</b>	
	RVDIS	
<b>CALIFICACIÓN</b>	<b>VaR Promedio</b>	<b>Limite de VaR</b>
	0.962%	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