

# GBMfondos

GBMUSD GBM FONDO DE INVERSION EN VALORES DENOMINADOS 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>BONOS DEL GOBIERNO FEDERAL COLOCADOS EN EL EXTERIOR UMS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)</b>						
D1SP	UMS26F	2026F	BBB-	3,360	70,469,214.18	9.19
D1SP	UMS31F	2031F	BBB-	1,690	38,320,558.32	5.00
<b>CHEQUERAS BANCARIAS EN DÓLARES</b>						
CHD	JPMOR	7231926		2,536,698	46,808,161.99	6.11
<b>EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)</b>						
D2SP	BSMXH06	250417	BBB+	1,300	24,269,034.07	3.17
D2SP	KUOBF33	270707	BB-	1,175	21,118,075.15	2.76
D2SP	LIVEE96	241002	BBB	1,000	18,587,462.96	2.43
OTROS TIPO DE VALOR D2SP - EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
<b>TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES (TIPO DE CAMBIO CIERRE)</b>						
JISP	CABE251	250506	Aa3	1,200	21,666,693.92	2.83
<b>TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)</b>						
1ISP	IBTA	N	ALTA	1,263,719	128,509,071.24	16.77
1ISP	FLOA	N	ALTA	1,012,769	111,791,728.04	14.59
1ISP	VDCA	N	ALTA	64,640	67,295,696.13	8.78
1ISP	TFRN	N	ALTA	62,850	65,316,181.71	8.52
1ISP	VTIP	*	ALTA	52,250	46,587,143.33	6.08
1ISP	SHV	*	ALTA	18,857	38,428,360.79	5.01
<b>TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO</b>					<b>761,661,511.89</b>	<b>99.38</b>
<b>OTROS VALORES</b>				2,813,048	<b>4,755,462.51</b>	<b>0.62</b>
<b>TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES</b>					<b>766,416,974.40</b>	<b>100.00</b>

	<b>CATEGORÍA</b> RVDIS	
<b>CALIFICACIÓN</b>	<b>VaR Promedio</b> 0.964%	<b>Límite de VaR</b> 4.080%

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