

GBMfondos

GBMDOL GBM FONDO DE INVERSION EN DOLARES, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 26 SEPTIEMBRE, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
CHEQUERAS BANCARIAS EN DÓLARES						
CHD	JPMOR	7819175		7,741,198	151,901,648.20	4.17
EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
OTROS TIPO DE VALOR D2SP - EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)				12,961	297,820,046.64	8.18
TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
JISP	CABE251	250506	Aa3	6,600	128,530,902.96	3.53
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	TFRN	N	ALTA	929,427	1,034,806,037.39	28.41
1ISP	IB01	N	ALTA	220,842	488,295,641.30	13.40
1ISP	FLOA	N	ALTA	4,115,364	487,752,529.74	13.39
1ISP	BIL	*	ALTA	269,426	485,170,708.33	13.32
1ISP	ERNA	N	ALTA	2,868,101	333,004,686.92	9.14
1ISP	VDCA	N	ALTA	184,750	208,977,932.65	5.74
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					3,616,260,134.13	99.27
OTROS VALORES				6,394,449	26,634,561.04	0.73
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					3,642,894,695.17	100.00

	CATEGORÍA	
	RVDIS	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
	1.094%	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