

GBMfondos

GBMUSD GBM FONDO DE INVERSION EN VALORES DENOMINADOS 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						
BONOS DEL GOBIERNO FEDERAL COLOCADOS EN EL EXTERIOR UMS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
D1SP	UMS26F	2026F	BBB-	3,630	82,711,981.70	11.90
D1SP	UMS31F	2031F	BBB-	1,690	40,203,212.76	5.79
CHEQUERAS BANCARIAS EN DÓLARES						
CHD	JPMOR	7231926		836,972	16,423,490.93	2.36
EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
D2SP	BSMXH06	250417	BBB+	1,300	26,132,554.64	3.76
D2SP	KUOBF33	270707	BB-	1,175	22,987,370.65	3.31
D2SP	LIVVE96	241002	BBB	1,000	19,988,602.66	2.88
D2SP	CEMEA69	250721	BBB-	750	15,220,658.16	2.19
D2SP	BNCEA73	251014	BBB	700	13,938,569.72	2.01
D2SP	GRUMD74	241201	BBB	700	13,929,371.65	2.00
OTROS TIPO DE VALOR D2SP - EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)				1,250	24,300,974.51	3.50
TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
JISP	CABE251	250506	Aa3	1,200	23,369,255.08	3.36
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	IBTA	N	ALTA	1,263,719	139,509,756.51	20.08
1ISP	VDCA	N	ALTA	64,640	73,116,825.80	10.52
1ISP	FLOA	N	ALTA	507,949	60,202,064.69	8.66
1ISP	VTIP	*	ALTA	52,250	50,515,330.04	7.27
1ISP	TFRN	N	ALTA	31,022	34,539,294.52	4.97
1ISP	SHV	*	ALTA	9,314	20,211,866.89	2.91
OTROS TIPO DE VALOR 1ISP - TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)				7,184	13,926,703.02	2.00
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					691,227,883.93	99.49
OTROS VALORES				3,011,853	3,573,746.54	0.51
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					694,801,630.47	100.00

CATEGORÍA
RVDIS

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.031%

Limite de VaR
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