

GBMfondos

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

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
CHEQUERAS BANCARIAS EN DÓLARES						
CHD	JPMOR	7819175		6,370,224	109,654,481.62	4.50
EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
D2SP	BINBL53	240606	BBB-	4,500	78,495,668.48	3.22
D2SP	LIVEE96	241002	BBB	3,900	66,634,400.36	2.73
D2SP	GRUMD74	241201	BBB	2,870	49,994,001.77	2.05
OTROS TIPO DE VALOR D2SP - EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
				4,831	81,295,849.29	3.34
TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
JISP	CABE251	250506	Aa3	6,600	110,435,400.44	4.53
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	TFRN	N	ALTA	899,286	861,072,190.36	35.34
1ISP	IB01	N	ALTA	167,990	318,088,393.04	13.05
1ISP	FLOA	N	ALTA	2,831,566	286,989,625.77	11.78
1ISP	ERNA	N	ALTA	1,967,942	195,122,110.53	8.01
1ISP	VDCA	N	ALTA	184,750	175,277,417.45	7.19
TREASURY BILLS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
D4SP	TBILQ12	240430	AA+	50,000	86,016,814.50	3.53
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					2,419,076,353.61	99.28
OTROS VALORES				5,445,844	17,531,823.59	0.72
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					2,436,608,177.20	100.00

	CATEGORÍA	
	RVDIS	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
	0.938%	2.950%

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