

GBMfondos

GBMDOL GBM FONDO DE INVERSION EN DOLARES, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 29 DICIEMBRE, 2023

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
CHEQUERAS BANCARIAS EN DÓLARES						
CHD	JPMOR	7819175		9,555,175	162,118,827.45	7.30
EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
D2SP	NAFI874	240221		5,000	84,200,137.93	3.79
D2SP	BINBL53	240606	BBB-	4,500	75,914,980.07	3.42
D2SP	GRUMD74	241201	BBB	2,870	48,598,726.66	2.19
D2SP	LIVEE96	241002	BBB	2,800	47,278,840.05	2.13
OTROS TIPO DE VALOR D2SP - EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
JISP	CABE251	250506	Aa3	5,600	91,525,667.09	4.12
TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
D8SP	BBVA2	2-18	BBB	3,800	64,816,066.75	2.92
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	TFRN	N	ALTA	694,024	643,104,055.29	28.97
1ISP	VDCA	N	ALTA	184,750	171,649,565.21	7.73
1ISP	IB01	N	ALTA	59,900	110,024,566.55	4.96
1ISP	ERNA	N	ALTA	943,396	90,643,238.62	4.08
1ISP	FLOA	N	ALTA	870,930	85,091,747.43	3.83
TREASURY BILLS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
D4SP	TBILX80	240102	AA+	170,000	288,432,200.00	12.99
D4SP	TBILC26	240206	AA+	105,000	177,221,471.70	7.98
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					2,201,201,195.94	99.16
OTROS VALORES				5,295,064	18,661,196.72	0.84
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					2,219,862,392.66	100.00

CATEGORÍA
RVDIS

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.067%

Límite de VaR
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

Lic. Julio Andres Maza Casas