

# GBMfondos

GBMUSD GBM FONDO DE INVERSION EN VALORES DENOMINADOS 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
<b>DIRECTO</b>						
<b>BONOS DEL GOBIERNO FEDERAL COLOCADOS EN EL EXTERIOR UMS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)</b>						
D1SP	UMS26F	2026F	BBB-	3,144	65,585,814.24	11.41
D1SP	UMS31F	2031F	BBB-	1,690	35,762,128.53	6.22
<b>CHEQUERAS BANCARIAS EN DÓLARES</b>						
CHD	JPMOR	7231926		1,728,610	29,328,635.98	5.10
<b>EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)</b>						
D2SP	KUOBF33	270707	BB-	1,175	18,224,309.42	3.17
D2SP	CEMEA69	250721	BB+	750	13,396,650.62	2.33
D2SP	GRUMD74	241201	BBB	700	11,853,347.97	2.06
D2SP	BNCEA73	251014	BBB	700	11,759,943.09	2.05
D2SP	CYDSA81	271004	BB	702	11,672,566.38	2.03
<b>OTROS TIPO DE VALOR D2SP - EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)</b>						
				2,400	39,875,643.99	6.94
<b>TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES (TIPO DE CAMBIO CIERRE)</b>						
JISP	CABE251	250506	Aa3	1,200	19,612,642.95	3.41
<b>TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)</b>						
1ISP	TFRN	N	ALTA	73,717	68,308,447.03	11.89
1ISP	FLOA	N	ALTA	538,490	52,611,639.37	9.16
1ISP	VTIP	*	ALTA	52,250	42,100,115.33	7.33
1ISP	VDCA	N	ALTA	19,481	18,099,622.08	3.15
<b>TREASURY BILLS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)</b>						
D4SP	TBILX80	240102	AA+	60,000	101,799,600.00	17.72
D4SP	TBILC26	240206	AA+	15,000	25,317,353.10	4.41
<b>TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO</b>					<b>565,308,460.08</b>	<b>98.39</b>
<b>OTROS VALORES</b>				2,514,784	<b>9,269,328.21</b>	<b>1.61</b>
<b>TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES</b>					<b>574,577,788.29</b>	<b>100.00</b>

## CATEGORÍA RVDIS

CALIFICACIÓN

VaR Promedio  
1.001%

Límite de VaR  
3.400%

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 período 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