

GBMfondos

GBMDOL GBM FONDO DE INVERSION EN DOLARES, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 19 DICIEMBRE, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
CHEQUERAS BANCARIAS EN DÓLARES						
CHD	JPMOR	7819175		18,362,121	372,721,671.29	4.85
EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
OTROS TIPO DE VALOR D2SP - EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)				14,160	324,873,145.73	4.23
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	BIL	*	ALTA	796,295	1,475,567,232.13	19.21
1ISP	TFRN	N	ALTA	961,563	1,121,124,856.53	14.59
1ISP	FLOA	N	ALTA	7,506,490	932,198,047.12	12.13
1ISP	IB01	N	ALTA	376,209	869,026,959.13	11.31
1ISP	VDST	N	ALTA	660,708	746,842,618.94	9.72
1ISP	USFR	*	ALTA	729,146	746,389,072.10	9.71
1ISP	ERNA	N	ALTA	4,608,067	558,973,448.02	7.28
1ISP	VDCA	N	ALTA	317,521	371,821,757.29	4.84
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					7,519,538,808.28	97.87
OTROS VALORES				6,666,985	163,534,472.37	2.13
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					7,683,073,280.65	100.00

CATEGORÍA RVDIS

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.057%

Limite de VaR
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

Lic. Julio Andres Maza Casas