

GBMfondos

GBMDOL GBM FONDO DE INVERSION EN DOLARES, S.A. DE C.V., F.I.R.V. CARTERA DE VALORES AL 31 OCTUBRE, 2023

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
CHEQUERAS BANCARIAS EN DÓLARES						
CHD	JPMOR	7819175		5,769,735	104,002,358.82	4.76
EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
D2SP	NAFI635	231121	F3	5,000	89,858,958.18	4.11
D2SP	BINBL53	240606	BBB-	4,500	81,142,211.43	3.71
D2SP	SIGM584	240207	BBB-	3,075	59,579,646.93	2.73
D2SP	FRESA61	231113	BBB	2,900	53,570,182.79	2.45
OTROS TIPO DE VALOR D2SP - EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)				6,551	114,003,347.03	5.22
TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
JISP	CABE251	250506	Aa3	4,800	82,370,256.82	3.77
TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
D8SP	BBVA2	2-18	BBB	3,800	68,049,858.39	3.11
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	TFRN	N	ALTA	393,469	384,766,793.68	17.60
1ISP	VDCA	N	ALTA	184,750	177,666,763.52	8.13
1ISP	SHV	*	ALTA	72,004	143,418,845.27	6.56
1ISP	ERNA	N	ALTA	943,396	95,161,013.01	4.35
TREASURY BILLS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
D4SP	TBILL60	231124	AA+	150,000	269,456,147.85	12.33
D4SP	TBILJ96	231107	AA+	100,000	180,094,684.80	8.24
D4SP	TBILY88	240125	AA+	65,000	115,675,860.95	5.29
TREASURY NOTES (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
D5SP	TNOTL19	240430	AA+	80,000	144,236,528.56	6.60
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					2,163,053,458.03	98.95
OTROS VALORES				5,849,352	22,986,041.27	1.05
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					2,186,039,499.30	100.00

CATEGORÍA RVDIS

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.002%

Limite 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