

GBMfondos

GBMDOL GBM FONDO DE INVERSION EN DOLARES, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 23 NOVIEMBRE, 2023

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
CHEQUERAS BANCARIAS EN DÓLARES						
CHD	JPMOR	7819175		7,711,372	132,556,173.06	6.09
EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
D2SP	NAFI874	240221		5,000	84,826,599.96	3.90
D2SP	BINBL53	240606	BBB-	4,500	77,888,171.48	3.58
D2SP	GRUMD74	241201	BBB	2,870	49,932,958.67	2.29
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	4,800	78,271,423.17	3.60
TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
D8SP	BBVA2	2-18	BBB	3,800	65,228,593.55	3.00
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	TFRN	N	ALTA	539,724	504,613,757.23	23.19
1ISP	VDCA	N	ALTA	184,750	171,270,736.25	7.87
1ISP	ERNA	N	ALTA	943,396	91,170,254.53	4.19
TREASURY BILLS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
D4SP	TBILL60	231124	AA+	150,000	257,845,500.00	11.85
D4SP	TBILN09	231205	AA+	105,000	180,172,534.61	8.28
D4SP	TBILY88	240125	AA+	65,000	110,693,840.99	5.09
D4SP	TBILN24	231228	AA+	62,000	106,020,706.74	4.87
TREASURY NOTES (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
D5SP	TNOTL19	240430	AA+	80,000	138,003,511.76	6.34
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					2,126,120,141.36	97.70
OTROS VALORES				5,656,607	49,959,180.69	2.30
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					2,176,079,322.05	100.00

	CATEGORÍA	
	RVDIS	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
	1.046%	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 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

Lic. Julio Andres Maza Casas