

GBMfondos

GBMUSD GBM FONDO DE INVERSION EN VALORES DENOMINADOS 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						
BONOS DEL GOBIERNO FEDERAL COLOCADOS EN EL EXTERIOR UMS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
D1SP	UMS26F	2026F	BBB-	3,144	65,598,032.25	12.94
D1SP	UMS31F	2031F	BBB-	1,690	34,840,034.83	6.87
CHEQUERAS BANCARIAS EN DÓLARES						
CHD	JPMOR	7231926		3,467,121	59,598,774.70	11.76
EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
D2SP	KUOBF33	270707	BB	1,175	18,264,829.67	3.60
D2SP	CEMEA69	250721	BB+	750	13,383,835.95	2.64
D2SP	GRUMD74	241201	BBB	700	12,178,770.41	2.40
D2SP	BNCEA73	251014	BBB	700	11,751,447.26	2.32
D2SP	CYDSA81	271004	BB	702	11,543,483.87	2.28
OTROS TIPO DE VALOR D2SP - EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
				2,000	33,135,221.93	6.54
TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
JISP	CABE251	250506	Aa3	1,200	19,567,855.79	3.86
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	TFRN	N	ALTA	55,367	51,765,253.90	10.21
1ISP	VTIP	*	ALTA	52,250	42,617,778.60	8.41
1ISP	FLOA	N	ALTA	263,340	25,879,347.44	5.10
1ISP	VDCA	N	ALTA	19,481	18,059,676.39	3.56
TREASURY BILLS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
D4SP	TBILN09	231205	AA+	45,000	77,216,800.55	15.23
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					495,401,143.54	97.72
OTROS VALORES				2,560,143	11,549,999.40	2.28
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					506,951,142.94	100.00

	CATEGORÍA	
	RVDIS	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
	0.982%	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 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