

GBMfondos

GBMDOL GBM FONDO DE INVERSION EN DOLARES, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 27 MARZO, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
CHEQUERAS BANCARIAS EN DÓLARES						
CHD	JPMOR	7819175		5,182,393	85,833,376.81	3.38
EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
D2SP	BINBL53	240606	BBB-	4,500	75,232,652.44	2.96
D2SP	LIVVE96	241002	BBB	3,900	65,171,666.72	2.57
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	6,600	106,212,469.12	4.18
TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
D8SP	BBVA2	2-18	BBB	7,020	118,571,039.85	4.67
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
11SP	TFRN	N	ALTA	899,286	824,853,221.89	32.49
11SP	IB01	N	ALTA	151,688	275,401,888.65	10.85
11SP	FLOA	N	ALTA	2,831,566	275,055,668.06	10.83
11SP	ERNA	N	ALTA	1,967,942	187,057,192.96	7.37
11SP	VDCA	N	ALTA	184,750	169,198,380.17	6.66
TREASURY BILLS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
D4SP	TBILL25	240402	AA+	140,000	231,840,930.58	9.13
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					2,521,981,571.92	99.33
OTROS VALORES				5,219,249	17,121,599.35	0.67
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					2,539,103,171.27	100.00

	CATEGORÍA	
	RVDIS	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
	1.003%	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

Lic. Julio Andres Maza Casas