

GBMfondos

GBMUSD GBM FONDO DE INVERSION EN VALORES DENOMINADOS 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						
BONOS DEL GOBIERNO FEDERAL COLOCADOS EN EL EXTERIOR UMS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
D1SP	UMS26F	2026F	BBB-	3,254	63,545,811.73	9.62
D1SP	UMS31F	2031F	BBB-	1,690	33,629,435.92	5.09
CHEQUERAS BANCARIAS EN DÓLARES						
CHD	JPMOR	7231926		1,772,341	29,354,405.63	4.44
EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
D2SP	KUOBF33	270707	BB-	1,175	18,648,151.44	2.82
D2SP	LIVEE96	241002	BBB	1,000	16,710,683.78	2.53
OTROS TIPO DE VALOR D2SP - EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
				4,250	70,639,607.56	10.69
TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
JISP	CABE251	250506	Aa3	1,200	19,311,358.02	2.92
TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
D8SP	BBVA2	2-18	BBB	930	15,708,129.21	2.38
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	IBTA	N	ALTA	1,078,122	96,781,664.29	14.65
1ISP	FLOA	N	ALTA	890,164	86,469,696.88	13.08
1ISP	TFRN	N	ALTA	92,920	85,229,127.75	12.90
1ISP	VDCA	N	ALTA	50,590	46,331,507.73	7.01
1ISP	VTIP	*	ALTA	52,250	41,460,864.84	6.27
TREASURY BILLS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
D4SP	TBILL25	240402	AA+	20,000	33,120,132.94	5.01
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					656,940,577.72	99.41
OTROS VALORES				2,481,610	3,896,225.23	0.59
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					660,836,802.95	100.00

	CATEGORÍA	
	RVDIS	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
	0.970%	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