

# GBMfondos

GBMDOL GBM FONDO DE INVERSIÓN EN DÓLARES, S.A. DE C.V., F.I.R.V.  
CARTERA DE VALORES AL 31 DICIEMBRE, 2025

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Valor Razonable	%
<b>DIRECTO</b>					
<b>CHEQUERAS BANCARIAS EN DÓLARES</b>					
CHD	JPMOR	7819175		407,006,838.61	3.73
<b>TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES (TIPO DE CAMBIO CIERRE)</b>					
JISP	CABEH57	260209	Aa3	367,577,895.30	3.37
<b>TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)</b>					
1ISP	VDST	N	ALTA	2,710,172,902.07	24.84
1ISP	BIL	*	ALTA	2,453,867,306.99	22.49
1ISP	FLOA	N	ALTA	1,136,251,698.37	10.42
1ISP	ERNA	N	ALTA	1,133,003,479.80	10.39
1ISP	USFR	*	ALTA	1,098,531,809.86	10.07
1ISP	TFRN	N	ALTA	1,056,571,599.56	9.68
<b>TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO</b>				10,362,983,530.56	94.99
<b>OTROS VALORES</b>				546,534,456.34	5.01
<b>TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES</b>				10,909,517,986.90	100.00

CATEGORÍA	CALIFICACIÓN
RVDIS	

VaR Promedio última semana	Límite de VaR
0.888%	2.400%

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

