

gbmfondos

GBMUSD GBM FONDO DE INVERSION EN VALORES DENOMINADOS EN DOLARES, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 31 DICIEMBRE, 2025

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-	3,630	69,753,497.67	9.70
D1SP	UMS31F	2031F	BBB-	1,690	37,053,841.11	5.15
CHEQUERAS BANCARIAS EN DÓLARES						
CHD	JPMOR	7231926		8,986,110	161,821,871.59	22.51
EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
D2SP	BINBM37	270411	BBB-	1,520	27,632,222.88	3.84
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	IBTA	N	ALTA	1,263,719	134,653,475.22	18.73
1ISP	VDCA	N	ALTA	64,640	71,227,431.37	9.91
1ISP	FLOA	N	ALTA	507,949	58,843,587.59	8.18
1ISP	SHY	*	ALTA	32,500	48,471,233.20	6.74
1ISP	VTIP	*	ALTA	52,250	46,537,804.28	6.47
1ISP	TFRN	N	ALTA	31,022	33,490,718.35	4.66
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					689,485,683.26	95.89
OTROS VALORES				3,417,370	29,541,891.96	4.11
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					719,027,575.22	100.00

CATEGORÍA		
RVDIS		
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
	0.903%	4.080%

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