

gbmfondos

GBMUSD GBM FONDO DE INVERSION EN VALORES DENOMINADOS EN DOLARES, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 30 JULIO, 2026

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	UMS31F	2031F	Baa3	1,690	34,831,382.88	5.64
EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
D2SP	BINBM37	270411	BBB-	1,520	26,614,154.66	4.31
TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
JISP	CABEI	280124	Aa2	2,000	34,862,819.90	5.65
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	IBTA	N	ALTA	1,916,024	197,975,251.02	32.07
1ISP	VDCA	N	ALTA	64,640	69,471,552.93	11.25
1ISP	FLOA	N	ALTA	507,949	58,121,231.80	9.41
1ISP	SHY	*	ALTA	32,500	46,215,402.84	7.49
1ISP	TI5A	N	ALTA	22,619	45,664,096.38	7.40
1ISP	TFRN	N	ALTA	31,022	32,965,567.29	5.34
TREASURY BILLS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
D4SP	TBILT22	260811	AA+	25,000	43,300,995.28	7.01
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					590,022,454.98	95.58
OTROS VALORES				3,924,779	27,312,044.34	4.42
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					617,334,499.32	100.00

CATEGORÍA
RVDIS

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
0.763%

Limite de VaR
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