

gbmfondos

GBMDINT GBM Fondo de Deuda Internacional en Pesos, S.A. de C.V. Fondo de Inversión de Renta Variable
CARTERA DE VALORES AL 31 AGOSTO, 2026

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
TRACKS EXTRANJEROS						
1I	FRMXNX	N	ALTA	1,360,905	1,348,520,764.50	21.88
1I	MB3M	N	ALTA	90,499	1,176,007,355.30	19.08
1I	IB1MXX	N	ALTA	117,815	1,112,173,600.00	18.05
1I	IBTMXX	N	ALTA	100,507	898,984,861.50	14.59
1I	VMSTX	N	ALTA	178,483	578,624,037.70	9.39
1I	TMX1X	N	ALTA	517,680	555,160,032.00	9.01
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					5,669,470,651.00	92.00
REPORTO						
BI	CETES	271028	mxAAA	40,125,697	369,769,626.00	6.00
TOTAL REPORTO					369,769,626.00	6.00
OTROS VALORES				98,223	123,191,353.48	2.00
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					6,162,431,630.48	100.00

CATEGORÍA
RVESACC

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
0.019%

Límite de VaR
1.040%

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