

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 AGOSTO, 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	33,054,763.90	5.37
CHEQUERAS BANCARIAS EN DÓLARES						
CHD	JPMOR	7231926		3,422,223	58,167,870.82	9.45
EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
D2SP	BINBM37	270411	BBB-	1,720	29,638,840.74	4.82
TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
JISP	CABEI	280124	Aa2	2,000	34,271,182.84	5.57
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	IBTA	N	ALTA	1,916,024	194,554,370.28	31.61
1ISP	VDCA	N	ALTA	64,640	68,339,774.92	11.10
1ISP	FLOA	N	ALTA	507,949	57,172,096.07	9.29
1ISP	SHY	*	ALTA	32,500	45,236,506.87	7.35
1ISP	TI5A	N	ALTA	22,619	44,743,152.78	7.27
1ISP	TFRN	N	ALTA	14,712	15,362,518.12	2.50
TREASURY BILLS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
D4SP	TBILB05	260908	AA+	10,000	16,984,999.08	2.76
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					597,526,076.42	97.09
OTROS VALORES				3,347,728	17,911,659.86	2.91
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					615,437,736.28	100.00

CALIFICACIÓN	CATEGORÍA
	RVDIS
	VaR Promedio
	0.740%
	Límite 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