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 SEPTIEMBRE, 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	34,453,740.92	5.50
CHEQUERAS BANCARIAS EN DÓLARES						
CHD	JPMOR	7231926		3,546,801	64,128,996.82	10.24
EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
D2SP	BINBM37	270411	BBB-	1,720	31,519,581.00	5.03
TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
JISP	CABEI	280124	Aa2	2,000	36,354,315.20	5.81
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	IBTA	N	ALTA	1,916,024	205,676,956.66	32.84
1ISP	VDCA	N	ALTA	64,640	72,146,499.96	11.52
1ISP	FLOA	N	ALTA	507,949	61,046,874.29	9.75
1ISP	SHY	*	ALTA	32,500	47,715,231.20	7.62
1ISP	TI5A	N	ALTA	22,619	47,150,106.94	7.53
1ISP	TFRN	N	ALTA	14,712	16,405,841.70	2.62
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					**616,598,144.69**	**98.46**
OTROS VALORES				3,540,458	**9,643,594.84**	**1.54**
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					**626,241,739.53**	**100.00**

CATEGORÍA
RVDIS

CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
AAAf.mxMRA6.mx	0.710%	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