

GBMfondos

GBMDOL GBM FONDO DE INVERSION EN DOLARES, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 14 NOVIEMBRE, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
D2SP	GRUMD74	241201	BBB	5,570	116,197,555.86	2.30
OTROS TIPO DE VALOR D2SP - EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)				8,860	219,030,795.21	4.33
TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
JISP	CABE251	250506	Aa3	6,600	133,152,518.80	2.63
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	TFRN	N	ALTA	1,065,037	1,244,034,071.85	24.62
1ISP	IB01	N	ALTA	376,209	870,344,505.49	17.22
1ISP	BIL	*	ALTA	437,261	818,128,781.15	16.19
1ISP	FLOA	N	ALTA	6,397,309	795,662,255.36	15.74
1ISP	ERNA	N	ALTA	4,360,956	529,742,843.28	10.48
1ISP	VDCA	N	ALTA	224,424	263,081,904.54	5.21
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					4,989,375,231.54	98.72
OTROS VALORES				8,609,424	64,464,163.41	1.28
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					5,053,839,394.95	100.00

	CATEGORÍA	
	RVDIS	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
	1.140%	2.400%

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