

# GBMfondos

## GBMDOL GBM FONDO DE INVERSION EN DOLARES, S.A. DE C.V., F.I.R.V. CARTERA DE VALORES AL 11 ABRIL, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
<b>DIRECTO</b>						
<b>CHEQUERAS BANCARIAS EN DÓLARES</b>						
CHD	JPMOR	7819175		8,129,662	133,619,118.92	5.63
<b>EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)</b>						
D2SP	BINBL53	240606	BBB-	4,500	74,779,859.47	3.15
D2SP	LIVEE96	241002	BBB	3,900	63,469,794.51	2.67
D2SP	GRUMD74	241201	BBB	2,870	47,654,747.43	2.01
<b>OTROS TIPO DE VALOR D2SP - EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)</b>						
				4,131	68,084,143.80	2.87
<b>TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES (TIPO DE CAMBIO CIERRE)</b>						
JISP	CABE251	250506	Aa3	6,600	105,286,136.56	4.43
<b>TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)</b>						
1ISP	TFRN	N	ALTA	899,286	820,474,697.27	34.55
1ISP	IB01	N	ALTA	167,990	303,111,762.00	12.76
1ISP	FLOA	N	ALTA	2,831,566	273,559,879.17	11.52
1ISP	ERNA	N	ALTA	1,967,942	185,951,949.50	7.83
1ISP	VDCA	N	ALTA	184,750	167,268,411.84	7.04
<b>TREASURY BILLS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)</b>						
D4SP	TBILQ12	240430	AA+	70,000	114,742,768.98	4.83
<b>TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO</b>					<b>2,358,003,269.45</b>	<b>99.29</b>
<b>OTROS VALORES</b>				5,200,101	16,885,226.08	0.71
<b>TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES</b>					<b>2,374,888,495.53</b>	<b>100.00</b>

	<b>CATEGORÍA</b>	
	RVDIS	
<b>CALIFICACIÓN</b>	<b>VaR Promedio</b>	<b>Límite de VaR</b>
	0.962%	2.950%

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