

GBMfondos

GBMDINT GBM Fondo de Deuda Internacional en Pesos, S.A. de C.V. Fondo de Inversión de Renta Variable
CARTERA DE VALORES AL 14 NOVIEMBRE, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
TRACKS EXTRANJEROS						
1I	IB1MXX	N	ALTA	129,897	1,061,128,593.00	49.94
1I	FRMXNX	N	ALTA	626,868	531,615,407.40	25.02
1I	MB3M	N	ALTA	33,064	371,827,824.80	17.50
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					1,964,571,825.20	92.46
REPORTO						
BI	CETES	251224	mxAAA	17,573,900	157,044,164.92	7.39
TOTAL REPORTO					157,044,164.92	7.39
OTROS VALORES				27,895	3,228,846.25	0.15
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					2,124,844,836.37	100.00

CALIFICACIÓN	CATEGORÍA
	RVESACC
	VaR Promedio
	0.011%
	Limite 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 período 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