

GBMfondos

GBMDOL GBM FONDO DE INVERSION EN DOLARES, S.A. DE C.V., F.I.R.V. CARTERA DE VALORES AL 22 DICIEMBRE, 2022

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN						
CHD	JPMOR	7819175		6,321,277	123,776,916.73	6.09
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA						
AIM	PGOLDMA	0103189		1,553,166	1,553,166.00	0.08
EAIM	FCSTONE	0002783		195,810	195,810.00	0.01
EAIM	PGOLDMA	0103189		1,388,144	1,388,144.00	0.07
TOTAL DISPONIBILIDADES					126,914,036.73	6.25
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1ISP	ERNA	N	ALTA	943,396	99,004,097.94	4.87
1ISP	SHV	*	ALTA	180,791	388,911,933.21	19.14
1ISP	USFR	*	ALTA	202,908	200,206,602.60	9.85
1ISP	VCSH	*	ALTA	118,065	174,843,760.76	8.60
1ISP	VDCA	N	ALTA	184,750	188,331,722.39	9.27
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					1,051,298,116.90	51.74
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
D4SP	TBILS39	230119	AA+	20,000	39,054,618.98	1.92
D4SP	TBILT12	230202	AA+	60,000	116,971,248.00	5.76
D4SP	TBILV58	230427	AA+	30,000	57,841,832.43	2.85
D5SP	TNOTN92	230731	AA+	20,000	38,156,345.56	1.88
TÍTULOS BANCARIOS						
D2SP	BINBL53	240606	BBB-	1,000	19,258,157.60	0.95
D2SP	BNCEA73	251014	BBB	1,000	19,026,490.89	0.94
D2SP	NAFI603	230106	F3	8,000	156,383,942.54	7.70
D2SP	NAFI633	231020	BBB-	5,000	93,904,109.14	4.62
PAPEL PRIVADO						
D2SP	ALPEB65	230808	BB+	700	13,968,230.34	0.69
D2SP	CYDSA81	271004	BB	50	943,161.58	0.05
D2SP	GRUMD74	241201	BBB	1,870	36,477,846.15	1.80
D2SP	JPMQ81	240601	A-	2,000	38,511,273.34	1.90
D2SP	KUOBF33	270707	BB-	1,481	27,971,300.75	1.38
D2SP	SCCOH87	250423	Baa1	1,250	23,922,082.19	1.18
D2SP	SIGM584	240207	BBB-	3,075	63,869,954.56	3.14
D8SP	BIMBO2	1-18	BBB	250	4,894,420.72	0.24
D8SP	FEMSA2	1-22	BBB+	1,300	50,594,240.39	2.49
J1SP	CABE251	250506	Aa3	2,800	51,541,255.30	2.54
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					853,290,510.46	41.99
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					1,904,588,627.36	93.73
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADOR						
LF	BONDESF	270318	mxAAA	2,889	288,115.85	0.01
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					288,115.85	0.01
OPERACIONES CON DERIVADOS						
FUTUROS						
FCSP	EC	H3		25	140,737.16	0.01
FCSP	US	H3		1	-5,507.16	0.00
FCSP	US	H3		1	-5,507.16	0.00
TOTAL OPERACIONES CON DERIVADOS					129,722.84	0.01
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					2,031,920,502.78	100.00

CATEGORÍA DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
0.934%

Límite de VaR
3.200%

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