

GBMfondos

GBMAAA GBM INSTRUMENTOS BURSATILES, 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 RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA						
EAIM	GBM-INT	0003848		674,069	674,069.00	1.27
TOTAL DISPONIBILIDADES					674,069.00	1.27
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1	FOTOLUZ	B	NULA	100,000	0.10	0.00
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1ISP	AIQ	*	ALTA	7,774	3,074,898.42	5.78
1ISP	BKCH	*	ALTA	9,392	2,418,347.49	4.55
1ISP	BUG	*	ALTA	5,555	2,288,572.45	4.30
1ISP	CTEC	*	ALTA	7,821	2,321,647.90	4.37
1ISP	EBIZ	*	ALTA	8,466	2,692,149.40	5.06
1ISP	FINX	*	ALTA	6,780	2,475,958.71	4.66
1ISP	GNOM	*	ALTA	9,983	2,537,293.06	4.77
1ISP	HEAL	N	ALTA	20,004	2,874,576.08	5.41
1ISP	HERO	*	ALTA	6,683	2,419,598.13	4.55
1ISP	ICLN	*	ALTA	6,568	2,585,020.96	4.86
1ISP	IDRV	*	ALTA	3,840	2,574,541.21	4.84
1ISP	IH2O	N	ALTA	2,196	2,369,508.17	4.46
1ISP	KWEB	*	ALTA	4,516	2,712,964.78	5.10
1ISP	LIT	*	ALTA	2,154	2,532,757.31	4.76
1ISP	MILN	*	ALTA	5,867	2,976,585.55	5.60
1ISP	RBOT	N	ALTA	14,833	2,717,838.84	5.11
1ISP	SKYY	*	ALTA	2,576	2,884,701.12	5.42
1ISP	SNSR	*	ALTA	4,671	2,675,288.39	5.03
1ISP	SOCL	*	ALTA	4,693	2,807,350.49	5.28
1ISP	YODA	N	ALTA	25,000	2,457,660.25	4.62
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					52,397,258.81	98.53
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					52,397,258.81	98.53
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADOR						
LF	BONDESF	240229	mxAAA	1,081	108,360.23	0.20
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					108,360.23	0.20
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					53,179,688.04	100.00

CATEGORÍA DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
2.951%

Límite de VaR
3.210%

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