

gbmfondos

GBMMXOP GBM MEXBOL OPTIMIZADO, S. A. de C. V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 22 DICIEMBRE, 2022

Tipo Valor	Emisora	Serie	Clasif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS MATERIALES						
1	CEMEX	CPO	ALTA	58,021	471,710.73	0.19
1	GCC	*	ALTA	9,649	1,278,974.95	0.51
1	GMEXICO	B	ALTA	110,519	8,062,361.05	3.24
1	PE&OLES	*	ALTA	4,012	1,032,648.68	0.41
EMPRESAS INDUSTRIALES						
00	COVAL	A1	NULA	31	0.00	0.00
1	ALFA	A	ALTA	1,169,124	14,999,860.92	6.02
1	ASUR	B	ALTA	2,605	1,268,218.20	0.51
1	GAP	B	ALTA	3,924	1,176,572.16	0.47
1	GCARSO	A1	ALTA	8,754	746,842.08	0.30
1	LASITE	B-1	ALTA	30,372	294,608.40	0.12
1	OMA	B	ALTA	103,062	15,836,506.92	6.36
1	ORBITA	*	ALTA	392,331	13,688,428.59	5.49
1	PNFRA	*	ALTA	8,110	1,353,396.80	0.54
1	VESTA	*	ALTA	29,176	1,343,263.04	0.54
1	VOLAR	A	ALTA	62,124	1,022,561.04	0.41
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1	ALSEA	*	ALTA	25,237	926,450.27	0.37
1	ELEKTRA	*	ALTA	120	127,852.80	0.05
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	116,842	13,110,840.82	5.26
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1	AC	*	ALTA	8,034	1,307,774.52	0.52
1	BMBO	A	ALTA	2,409	206,451.30	0.08
1	CUERVO	*	ALTA	28,999	1,214,254.69	0.49
1	FEMSA	UBD	ALTA	234,515	35,728,960.25	14.34
1	GRUMA	B	ALTA	5,189	1,334,351.35	0.54
1	KIMBER	A	ALTA	6,141	207,258.75	0.08
1	KOF	UBL	ALTA	9,081	1,223,483.13	0.49
1	WALMEX	*	ALTA	62,789	4,554,086.17	1.83
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1	BOLSA	A	ALTA	20,675	782,548.75	0.31
1	GENEREA	*	ALTA	65,186	1,413,232.48	0.57
1	GFINBUR	O	ALTA	516,672	17,835,517.44	7.16
1	GFNORTE	O	ALTA	123,048	18,025,301.52	7.24
1	Q	*	ALTA	13,253	1,133,926.68	0.46
1	R	A	ALTA	9,922	1,391,758.94	0.56
41	BBAJO	O	ALTA	3,362	208,780.20	0.08
EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES						
1	AMX	L	ALTA	898,502	16,226,946.12	6.51
1	MEGA	CPO	ALTA	284,580	15,031,515.60	6.03
1	TLEvisa	CPO	ALTA	45,451	815,390.94	0.33
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					195,383,836.28	78.43
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					195,383,836.28	78.43
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADOR						
LF	BONDESIF	241128	mxAAA	27,421	2,749,970.56	1.10
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					2,749,970.56	1.10
OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES						
PRESTAMISTA						
1	ALSEA	*	ALTA	4,000	146,840.00	0.06
1	BMBO	A	ALTA	9,900	848,430.00	0.34
1	BMBO	A	ALTA	3,000	257,100.00	0.10
1	BOLSA	A	ALTA	9,097	344,321.45	0.14
1	CEMEX	CPO	ALTA	25,900	210,567.00	0.08
1	CEMEX	CPO	ALTA	6,563	53,957.19	0.02
1	CEMEX	CPO	ALTA	6,400	52,032.00	0.02
1	CEMEX	CPO	ALTA	27,000	219,510.00	0.09
1	CEMEX	CPO	ALTA	31,000	252,030.00	0.10
1	ELEKTRA	*	ALTA	899	957,830.56	0.38
1	ELEKTRA	*	ALTA	30	31,963.20	0.01
1	ELEKTRA	*	ALTA	50	53,272.00	0.02
1	GCARSO	A1	ALTA	6,200	530,224.00	0.21
1	GFNORTE	O	ALTA	6,000	878,940.00	0.35
1	KIMBER	A	ALTA	3,000	101,250.00	0.04
1	KIMBER	A	ALTA	30,200	1,019,250.00	0.41
1	KIMBER	A	ALTA	1,400	47,250.00	0.02
1	LASITE	B-1	ALTA	37	358.90	0.00
1	LASITE	B-1	ALTA	20,727	201,051.90	0.08
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	7,000	785,470.00	0.32
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	10,000	1,122,100.00	0.45
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	314	35,233.94	0.01
1	MEGA	CPO	ALTA	2,000	105,640.00	0.04
1	MEGA	CPO	ALTA	270	14,261.40	0.01
1	PE&OLES	*	ALTA	650	167,303.50	0.07
1	PE&OLES	*	ALTA	300	77,217.00	0.03
1	SITES1	A-1	ALTA	17,800	349,770.00	0.14
1	SITES1	A-1	ALTA	114,914	2,258,060.10	0.91
1	SITES1	A-1	ALTA	44,999	884,230.35	0.35
1	WALMEX	*	ALTA	333,268	24,171,928.04	9.70
1	WALMEX	*	ALTA	181,792	13,185,373.76	5.29
1	WALMEX	*	ALTA	1,225	88,849.25	0.04
1	WALMEX	*	ALTA	985	71,442.05	0.03
1	WALMEX	*	ALTA	2,500	181,325.00	0.07
1	WALMEX	*	ALTA	653	47,362.09	0.02
41	BBAJO	O	ALTA	14,000	869,400.00	0.35
41	BBAJO	O	ALTA	6,000	372,600.00	0.15
TOTAL OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES					50,993,144.68	20.47
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					249,126,951.52	100.00

CATEGORÍA
ESPECIALIZADAS EN ACCIONES INDIZADAS AL IPC

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.641%

Límite de VaR
1.750%

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