

GBMfondos

GBMUSD GBM FONDO DE INVERSION EN VALORES DENOMINADOS EN DOLARES, S.A. DE C.V., F.I.R.V. CARTERA DE VALORES AL 23 SEPTIEMBRE, 2021

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN						
CHD	BANAMEX	2528508		1	14.84	0.00
CHD	JPMOR	7231926		4,717,873	94,496,629.64	12.09
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA						
AIM	PGOLDMA	0103191		337,987	337,987.00	0.04
EAIM	FCSTONE	0002780		200,289	200,289.00	0.03
EAIM	PGOLDMA	0103191		1,965,624	1,965,624.00	0.25
TOTAL DISPONIBILIDADES					97,000,544.48	12.41
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1ISP	VDCA	N	NA	46,000	50,048,112.24	6.40
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					50,048,112.24	6.40
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
D1SP	UMS22F	2022F	BBB-	11,621	261,904,670.09	33.51
D1SP	UMS26F	2026F	BBB-	3,044	90,900,379.92	11.63
D1SP	UMS31F	2031F	BBB-	1,990	59,087,480.96	7.56
TÍTULOS BANCARIOS						
D2SP	BINBL53	240606	BBB-	1,350	29,265,177.35	3.74
D2SP	BINBM37	270411	BBB-	500	11,074,951.77	1.42
D2SP	BNCEA73	251014	BBB	1,500	33,925,827.24	4.34
D2SP	BSMXG23	281001	Baa3	700	15,516,916.32	1.99
PAPEL PRIVADO						
D2SP	AXTEC97	241114	Ba3	1,380	29,209,030.07	3.74
D2SP	CYDSA81	271004	BB	402	8,711,297.31	1.11
D2SP	GCCAB00	240623	BBB-	2,000	41,699,499.27	5.34
D2SP	KUOBF33	270707	BB-	825	17,500,076.68	2.24
D2SP	TERRA76	221110	Baa3	500	10,493,505.13	1.34
J1SP	CABE251	250506	Aa3	1,200	24,955,141.42	3.19
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					634,243,953.53	81.16
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					684,292,065.77	87.56
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADOR						
LD	BONDESD	260212	mxAAA	412	40,969.37	0.01
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					40,969.37	0.01
OPERACIONES CON DERIVADOS						
FUTUROS						
FCSP	US	Z1		3	95,766.05	0.01
FCSP	US	Z1		2	63,844.03	0.01
TOTAL OPERACIONES CON DERIVADOS					159,610.08	0.02
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					781,493,189.70	100.00

CATEGORÍA DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.153%

Límite de VaR
3.400%

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

Ing. Fernando Castro Tapia