

GBMfondos

GBMDOL GBM FONDO DE INVERSION EN DOLARES, S.A. DE C.V., F.I.R.V. CARTERA DE VALORES AL 31 AGOSTO, 2021

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN						
CHD	BANAMEX	2531509		0	8.67	0.00
CHD	JPMOR	7819175		33,744,380	677,502,793.09	28.10
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA						
AIM	PGOLDMA	0103189		3,255,492	3,255,492.00	0.14
EAIM	FCSTONE	0002783		200,775	200,775.00	0.01
EAIM	PGOLDMA	0103189		2,353,007	2,353,007.00	0.10
TOTAL DISPONIBILIDADES					683,312,075.76	28.35
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1ISP	SHV	*	ALTA	117,142	259,816,437.25	10.78
1ISP	USFR	*	NA	266,900	134,502,987.23	5.58
1ISP	VCSH	*	NA	118,065	196,036,218.10	8.13
1ISP	VDCA	N	NA	184,750	201,619,986.59	8.36
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					791,975,629.17	32.85
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
D1SP	UMS22F	2022F	BBB-	29,882	670,540,444.91	27.82
M	BONOS	230309	mxAAA	500,000	52,577,301.00	2.18
TÍTULOS BANCARIOS						
D2SP	BBVAH99	300922	BB	1,400	30,504,281.14	1.27
D2SP	BINBL53	240606	BBB-	500	10,849,704.15	0.45
PAPEL PRIVADO						
D2SP	AXTEC97	241114	Ba3	172	3,657,653.00	0.15
D2SP	CYDSA81	271004	BB	50	1,085,024.07	0.05
D2SP	GCCAB00	240623	BBB-	4,050	84,444,236.90	3.50
D2SP	KUOBF33	270707	BB-	1,081	22,920,170.77	0.95
JISP	CABE251	250506	Aa3	2,800	58,459,627.60	2.43
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					935,038,443.54	38.79
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					1,727,014,072.71	71.64
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADOR						
LD	BONDESD	260212	mxAAA	3,692	367,295.49	0.02
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					367,295.49	0.02
OPERACIONES CON DERIVADOS						
FUTUROS						
FCSP	PE	U1		72	-93,942.02	0.00
FCSP	PE	U1		35	-45,666.26	0.00
FCSP	US	Z1		10	100,387.50	0.00
TOTAL OPERACIONES CON DERIVADOS					-39,220.78	0.00
TOTAL DE INVERSION EN VALORES					2,410,654,223.18	100.00

CATEGORÍA DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.175%

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

Ing. Fernando Castro Tapia