

# GBMfondos

GBMDOL GBM FONDO DE INVERSION EN DOLARES, S.A. DE C.V., F.I.R.V.  
CARTERA DE VALORES AL 27 OCTUBRE, 2022

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
<b>DISPONIBILIDADES</b>						
<b>DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN</b>						
CHD	BANAMEX	2531509		0	8.57	0.00
CHD	JPMOR	7819175		15,635,188	310,485,117.71	14.78
<b>DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA</b>						
AIM	PGOLDMA	0103189		1,508,123	1,508,123.00	0.07
EAIM	FCSTONE	0002783		198,581	198,581.00	0.01
EAIM	PGOLDMA	0103189		464,363	464,363.00	0.02
<b>TOTAL DISPONIBILIDADES</b>					<b>312,656,193.28</b>	<b>14.89</b>
<b>TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>						
<b>INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO</b>						
<b>EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS</b>						
1ISP	ERNA	N	ALTA	943,396	99,515,284.61	4.74
1ISP	SHV	*	ALTA	180,791	394,918,233.28	18.80
1ISP	USFR	*	ALTA	202,908	202,556,296.93	9.64
1ISP	VCSH	*	ALTA	118,065	173,918,465.04	8.28
1ISP	VDCA	N	ALTA	184,750	187,841,739.52	8.94
<b>TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO</b>					<b>1,058,750,019.38</b>	<b>50.41</b>
<b>INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA</b>						
<b>TÍTULOS BANCARIOS</b>						
D2SP	BINBL53	240606	BBB-	1,000	19,543,853.18	0.93
D2SP	BNCEA73	251014	BBB	1,000	18,916,639.17	0.90
D2SP	GSL30	231117	A2	1,126	22,321,774.07	1.06
D2SP	NAFI473	221103	F3	10,000	198,474,657.29	9.45
D2SP	NAFI633	231020	BBB-	5,000	94,593,604.60	4.50
D8SP	BSMX2	1-21	Baa1	3,603	72,927,838.54	3.47
<b>PAPEL PRIVADO</b>						
D2SP	ALPEA82	201122	BB+	250	5,040,438.54	0.24
D2SP	ALPEB65	230808	BB+	200	4,014,214.68	0.19
D2SP	CYDSA81	271004	BB	50	839,924.82	0.04
D2SP	GRUMD74	241201	BBB	1,870	37,352,673.78	1.78
D2SP	JPMQ81	240601	A-	2,000	38,977,227.14	1.86
D2SP	KUOBF33	270707	BB-	1,481	26,450,724.92	1.26
D2SP	SCCOH87	250423	Baa1	1,250	23,772,142.55	1.13
D2SP	SIGM584	240207	BBB-	3,075	60,477,182.92	2.88
D8SP	FEMSA2	1-22	BBB+	1,300	51,846,749.61	2.47
JISP	CABE251	250506	Aa3	2,800	52,105,925.07	2.48
<b>TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA</b>					<b>727,655,570.88</b>	<b>34.64</b>
<b>TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>					<b>1,786,405,590.26</b>	<b>85.05</b>
<b>OPERACIONES DE REPORTO</b>						
<b>REPORTADOR</b>						
LF	BONDESF	270617	mxAAA	6,116	608,104.31	0.03
<b>TOTAL OPERACIONES DE REPORTO</b>					<b>608,104.31</b>	<b>0.03</b>
<b>OPERACIONES CON DERIVADOS</b>						
<b>FUTUROS</b>						
FCSP	EC	Z2		5	150,797.67	0.01
FCSP	EC	Z2		2	60,319.07	0.00
FCSP	EC	Z2		8	241,276.28	0.01
FCSP	EC	Z2		2	60,319.07	0.00
FCSP	EC	Z2		6	180,957.21	0.01
FCSP	EC	Z2		2	60,319.07	0.00
FCSP	US	Z2		1	17,375.84	0.00
<b>OPCIONES</b>						
OCSF	USZ2	P11400		4	-19,858.10	-0.00
<b>TOTAL OPERACIONES CON DERIVADOS</b>					<b>751,506.11</b>	<b>0.04</b>
<b>TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES</b>					<b>2,100,421,393.96</b>	<b>100.00</b>

**CATEGORÍA**  
DISCRECIONAL

**CALIFICACIÓN**

**VaR Promedio**  
1.023%

**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