

GBMfondos

GBMDOL GBM FONDO DE INVERSION EN DOLARES, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 31 OCTUBRE, 2022

| Tipo Valor | Emisora | Serie | Calif. / Bursatilidad | Cant. Títulos | Valor Razonable | Participación Porcentual |
|---|---------|---------|-----------------------|---------------|-------------------------|--------------------------|
| DISPONIBILIDADES | | | | | | |
| DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN | | | | | | |
| CHD | BANAMEX | 2531509 | | 0 | 8.55 | 0.00 |
| CHD | JPMOR | 7819175 | | 13,764,814 | 272,685,087.28 | 13.01 |
| DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA | | | | | | |
| AIM | PGOLDMA | 0103189 | | 1,504,493 | 1,504,493.00 | 0.07 |
| EAIM | FCSTONE | 0002783 | | 198,103 | 198,103.00 | 0.01 |
| EAIM | PGOLDMA | 0103189 | | 1,332,671 | 1,332,671.00 | 0.06 |
| TOTAL DISPONIBILIDADES | | | | | 275,720,362.83 | 13.16 |
| TÍTULOS PARA NEGOCIAR | | | | | | |
| INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO | | | | | | |
| EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS | | | | | | |
| 1ISP | ERNA | N | ALTA | 943,396 | 99,257,054.48 | 4.74 |
| 1ISP | SHV | * | ALTA | 180,791 | 393,860,188.48 | 18.80 |
| 1ISP | USFR | * | ALTA | 202,908 | 202,028,531.39 | 9.64 |
| 1ISP | VCSH | * | ALTA | 118,065 | 173,055,438.11 | 8.26 |
| 1ISP | VDCA | N | ALTA | 184,750 | 186,950,395.41 | 8.92 |
| TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO | | | | | 1,055,151,607.87 | 50.35 |
| INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA | | | | | | |
| VALORES GUBERNAMENTALES | | | | | | |
| D5SP | TNOTN92 | 230731 | AA+ | 20,000 | 38,340,803.36 | 1.83 |
| TÍTULOS BANCARIOS | | | | | | |
| D2SP | BINBL53 | 240606 | BBB- | 1,000 | 19,489,446.11 | 0.93 |
| D2SP | BNCEA73 | 251014 | BBB | 1,000 | 18,826,606.12 | 0.90 |
| D2SP | GSL30 | 231117 | A2 | 1,126 | 22,284,634.18 | 1.06 |
| D2SP | NAFI473 | 221103 | F3 | 10,000 | 198,068,716.69 | 9.45 |
| D2SP | NAFI633 | 231020 | BBB- | 5,000 | 94,262,310.55 | 4.50 |
| D8SP | BSMX2 | 1-21 | Baa1 | 3,603 | 72,737,509.88 | 3.47 |
| PAPEL PRIVADO | | | | | | |
| D2SP | ALPEA82 | 201122 | BB+ | 250 | 5,051,868.43 | 0.24 |
| D2SP | ALPEB65 | 230808 | BB+ | 200 | 4,012,415.95 | 0.19 |
| D2SP | CYDSA81 | 271004 | BB | 50 | 843,401.24 | 0.04 |
| D2SP | GRUMD74 | 241201 | BBB | 1,870 | 37,266,799.06 | 1.78 |
| D2SP | JPMQ81 | 240601 | A- | 2,000 | 38,881,015.45 | 1.86 |
| D2SP | KUOBF33 | 270707 | BB- | 1,481 | 26,360,284.56 | 1.26 |
| D2SP | SCCOH87 | 250423 | Baa1 | 1,250 | 23,749,051.59 | 1.13 |
| D2SP | SIGM584 | 240207 | BBB- | 3,075 | 60,006,708.85 | 2.86 |
| D8SP | FEMSA2 | 1-22 | BBB+ | 1,300 | 51,487,022.00 | 2.46 |
| JISP | CABE251 | 250506 | Aa3 | 2,800 | 51,990,994.90 | 2.48 |
| TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA | | | | | 763,659,588.92 | 36.44 |
| TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR | | | | | 1,818,811,196.79 | 86.79 |
| OPERACIONES DE REPORTO | | | | | | |
| REPORTADOR | | | | | | |
| LF | BONDEF | 290322 | mxAAA | 6,390 | 633,252.35 | 0.03 |
| TOTAL OPERACIONES DE REPORTO | | | | | 633,252.35 | 0.03 |
| OPERACIONES CON DERIVADOS | | | | | | |
| FUTUROS | | | | | | |
| FCSP | EC | Z2 | | 6 | 101,775.63 | 0.00 |
| FCSP | EC | Z2 | | 2 | 33,925.21 | 0.00 |
| FCSP | EC | Z2 | | 2 | 33,925.21 | 0.00 |
| FCSP | EC | Z2 | | 8 | 135,700.84 | 0.01 |
| FCSP | EC | Z2 | | 5 | 84,813.02 | 0.00 |
| FCSP | EC | Z2 | | 2 | 33,925.21 | 0.00 |
| FCSP | US | Z2 | | 1 | -14,857.73 | -0.00 |
| OPCIONES | | | | | | |
| OCSP | USZ2 | P11400 | | 4 | -22,286.59 | -0.00 |
| TOTAL OPERACIONES CON DERIVADOS | | | | | 386,920.80 | 0.02 |
| TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES | | | | | 2,095,551,732.77 | 100.00 |

CATEGORÍA
DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.018%

Limite 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