GBMfondos

GBMPAT GBM FONDO PATRIMONIAL, S.A. DE C.V., F.I.I.D.
CARTERA DE VALORES AL 17 NOVIEMBRE, 2022

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN						
CHD	JPMOR	3128821		192,928	3,745,808.35	0.11
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA						
AIM	GBM	0778088		723,475	723,675.00	0.02
AIM	PGOLDMA	0103190		4,013,205	4,013,205.00	0.12
BI	CETES	230112	mxAAA	31,599	311,143.72	0.01
EAIM	FCSTONE	0002784		194,155	194,155.00	0.01
EAIM	PGOLDMA	0103190		6,340,274	6,340,274.00	0.18
TOTAL DISPONIBILIDADES					**15,328,261.07**	**0.45**
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
BI	CETES	230112	mxAAA	268,401	2,642,845.88	0.08
BI	CETES	230309	mxAAA	10,000,000	96,885,930.00	2.83
D1SP	UMS31F	2031F	BBB-	1,000	23,124,378.91	0.67
M	BONOS	231207	mxAAA	3,700,000	374,066,825.40	10.91
S	UDIBONO	231116	mxAAA	73,186	54,525,979.36	1.59
S	UDIBONO	251204	mxAAA	65,629	50,397,454.49	1.47
2U	CBIC007	221208	mxAAA	473,272	368,949,723.11	10.76
TÍTULOS BANCARIOS						
D2	BACR402	230718	A	300	30,025,172.14	0.88
D2	BACR842	230901	A	500	50,275,501.30	1.47
D2	BAC446	230825	A-	100	10,178,203.25	0.30
D2	BAC589	230803	A-	60	153,368,128.61	4.47
D2	MS789	250909	A-	18	44,729,621.91	1.30
D2SP	BNCEA73	251014	BBB	1,500	28,126,829.14	0.82
94	BINBUR	14-7	mxAAA	950,000	96,701,769.20	2.82
94	BINBUR	18	mxAAA	570,700	57,581,703.89	1.68
94	BLADEX	20	mxAAA	500,000	50,582,510.00	1.47
94	HSBC	13-2	AAA.mx	750,000	75,746,346.00	2.21
PAPEL PRIVADO						
D2	CONM151	351215	mxAAA	1,650	24,733,844.96	0.72
D2	GS861	240905	BBB+	24	60,243,078.43	1.76
D2SP	SIGM584	240207	BBB-	750	15,135,470.14	0.44
D8	CIT0623	FLOAT	BBB+	36	90,216,982.50	2.63
D8	RCO2	1-22	BBB	3,000	23,704,024.21	0.69
JE	AMX	1122	mxAAA	7,656	78,689,602.72	2.29
JI	CABEI	1-22S	mxAAA	500,000	50,238,436.50	1.46
90	PAMMCB	14U	mxAAA	98,724	53,426,202.80	1.56
91	ARA	21X	AA-(mex)	800,000	80,026,273.60	2.33
91	DAIMLER	18-2	mxAAA	100,000	10,320,022.90	0.30
91	DAIMLER	20-2	mxAAA	995,000	99,774,422.00	2.91
91	DESCB	22	AA+(mex)	325,250	32,800,703.04	0.96
91	DHIC	15	AA+(mex)	300,000	30,192,645.00	0.88
91	FERROMX	21-2	mxAAA	600,000	60,253,206.00	1.76
91	GAP	21	mxAAA	300,000	30,510,938.70	0.89
91	GBM	21	HR AA+	650,000	65,198,197.35	1.90
91	GBM	22	HR AA+	600,000	60,240,732.00	1.76
91	GCARSO	20	AAA(mex)	500,000	50,375,928.00	1.47
91	GMXT	19-2	mxAAA	700,000	69,735,953.00	2.03
91	OMA	13	AAA.mx	50,000	4,977,237.30	0.15
91	OSM	15	mxAA-	100,000	9,559,107.60	0.28
91	RCO	12	mxAAA	8,802	485,639.37	0.01
91	SIPYTCB	13	HR C	76,782	4,169,572.57	0.12
91	SORIANA	20	AA+(mex)	950,000	95,347,050.20	2.78
91	STORAGE	21-2V	AA-(mex)	340,000	34,270,880.04	1.00
91	TIPMXCB	20	AAA(mex)	610,500	56,372,027.88	1.64
91	VWLEASE	19-2	mxAAA	1,000,000	101,314,984.00	2.95
91	VWLEASE	21	mxAAA	400,000	40,194,784.40	1.17
95	CFE	21	mxAAA	600,000	60,126,825.60	1.75
95	CFECB	09-2U	AAA.mx	93,081	9,262,375.91	0.27
95	FEFA	18-3	mxAAA	480,027	48,356,592.71	1.41
95	TFOVICB	13U	mxAAA	263,177	26,656,169.04	0.78
95	TFOVICB	13-3U	mxAAA	99,236	11,720,199.31	0.34
95	TFOVIS	14U	AAA.mx	55,253	12,268,344.13	0.36
95	TFOVIS	14-3U	mxAAA	126,431	26,472,636.72	0.77
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					**3,095,280,013.22**	**90.25**
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					**3,095,280,013.22**	**90.25**
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADOR						
LF	BONDESF	290322	mxAAA	3,228,117	319,046,289.54	9.30
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					**319,046,289.54**	**9.30**
OPERACIONES CON DERIVADOS						
FUTUROS						
FB	DC24	DC22		700	192,500.00	0.01
FCSP	EC	Z2		6	43,684.87	0.00
FCSP	PE	Z2		1	-2,426.75	-0.00
FCSP	PE	Z2		158	-383,426.54	-0.01
TOTAL OPERACIONES CON DERIVADOS					**-149,668.42**	**-0.00**
TOTAL DE INVERSION EN VALORES					**3,429,504,895.41**	**100.00**

CATEGORÍA
DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN **VaR Promedio** **Límite de VaR**

AAAf/S4(mex)	0.045%	0.490%

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

Lic. Julio Andres Maza Casas