

GBMfondos

GBMUSD GBM FONDO DE INVERSION EN VALORES DENOMINADOS 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	2528508		1	14.68	0.00
CHD	JPMOR	7231926		1,067,525	21,147,991.43	4.51
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA						
AIM	PGOLDMA	0103191		559,542	559,542.00	0.12
EAIM	FCSTONE	0002780		198,097	198,097.00	0.04
EAIM	PGOLDMA	0103191		2,016,140	2,016,140.00	0.43
TOTAL DISPONIBILIDADES					23,921,785.11	5.10
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1ISP	EMB	*	ALTA	6,840	10,691,143.46	2.28
1ISP	FLOT	*	ALTA	6,840	6,807,643.19	1.45
1ISP	SHY	*	ALTA	8,639	13,862,435.72	2.95
1ISP	VCSH	*	ALTA	6,415	9,402,876.68	2.00
1ISP	VDCA	N	ALTA	46,000	46,547,865.70	9.92
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					87,311,964.75	18.61
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
D1SP	UMS26F	2026F	BBB-	3,144	76,743,746.43	16.35
D1SP	UMS31F	2031F	BBB-	1,990	45,212,470.80	9.64
TÍTULOS BANCARIOS						
D2SP	BINBL53	240606	BBB-	1,350	26,310,752.25	5.61
D2SP	BINBM37	270411	BBB-	500	9,012,775.78	1.92
D2SP	BNCEA73	251014	BBB	1,500	28,239,909.18	6.02
D2SP	BSMXG23	281001	Baa3	700	13,478,489.00	2.87
D8SP	BSMX2	1-21	Baa1	380	7,671,455.39	1.63
PAPEL PRIVADO						
D2SP	ALPEA82	201122	BB+	1,000	20,207,473.73	4.31
D2SP	CYDSA81	271004	BB	1,102	18,588,563.24	3.96
D2SP	GRUMD74	241201	BBB	1,200	23,914,523.46	5.10
D2SP	JPMQ81	240601	A-	500	9,720,253.86	2.07
D2SP	KUOBF33	270707	BB-	1,175	20,913,797.68	4.46
D2SP	LIVEE96	241002	BBB	700	13,430,681.48	2.86
D2SP	SCCOH87	250423	Baa1	250	4,749,810.32	1.01
D2SP	SIGM584	240207	BBB-	875	17,075,079.76	3.64
JISP	CABE251	250506	Aa3	1,200	22,281,854.96	4.75
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					357,551,637.32	76.20
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					444,863,602.07	94.80
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADOR						
LF	BONDESF	290322	mxAAA	3,845	381,041.52	0.08
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					381,041.52	0.08
OPERACIONES CON DERIVADOS						
FUTUROS						
FCSP	EC	Z2		1	16,962.60	0.00
FCSP	EC	Z2		2	33,925.21	0.01
FCSP	EC	Z2		2	33,925.21	0.01
FCSP	EC	Z2		2	33,925.21	0.01
FCSP	US	Z2		1	-14,857.73	-0.00
OPCIONES						
OCSF	USZ2	P11400		4	-22,286.59	-0.00
TOTAL OPERACIONES CON DERIVADOS					81,593.91	0.02
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					469,248,022.61	100.00

CATEGORÍA
DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
0.989%

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