

GBMfondos

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

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN						
CHD	BANAMEX	2531509		0	8.86	0.00
CHD	JPMOR	7819175		23,384,564	479,558,937.23	22.49
TOTAL DISPONIBILIDADES					479,558,946.09	22.49
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1ISP	SHV	*	ALTA	117,142	265,260,813.77	12.44
1ISP	USFR	*	ALTA	266,900	137,328,904.41	6.44
1ISP	VCSH	*	ALTA	118,065	196,748,173.66	9.23
1ISP	VDCA	N	ALTA	184,750	204,649,905.07	9.60
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					803,987,796.91	37.71
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
D1SP	UMS22F	2022F	BBB-	27,882	613,622,651.29	28.78
TÍTULOS BANCARIOS						
D2SP	BBVAH99	300922	BB	2,400	51,927,262.64	2.44
D2SP	BINBL53	240606	BBB-	500	10,731,914.66	0.50
PAPEL PRIVADO						
AIM	PGOLDMA	0103189		483,913	483,913.00	0.02
D2SP	CYDSA81	271004	BB	50	1,080,762.06	0.05
D2SP	GCCAB00	240623	BBB-	4,050	85,381,044.52	4.00
D2SP	KUOBF33	270707	BB-	1,081	23,499,200.81	1.10
EAIM	FCSTONE	0002783		205,075	205,075.00	0.01
EAIM	PGOLDMA	0103189		3,370,411	3,370,411.00	0.16
JISP	CABE251	250506	Aa3	2,800	58,384,318.62	2.74
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					848,686,553.60	39.80
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					1,652,674,350.51	77.51
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADOR						
LD	BONDESD	250416	mxAAA	554	55,043.51	0.00
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					55,043.51	0.00
OPERACIONES CON DERIVADOS						
FUTUROS						
FCSP	US	H2		3	-34,606.41	0.00
FCSP	US	H2		2	-23,070.94	0.00
FCSP	US	H2		2	-23,070.94	0.00
TOTAL OPERACIONES CON DERIVADOS					-80,748.29	0.00
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					2,132,207,591.82	100.00

CATEGORÍA DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.066%

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