

GBMfondos

GBMFIBR GBM INVERSION EN FIBRAS, S.A. DE C.V. F.I.R.V. CARTERA DE VALORES AL 31 AGOSTO, 2022

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS MATERIALES						
1	CEMEX	CPO	ALTA	68,000	507,960.00	2.94
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1	PINFRA	*	ALTA	5,900	835,499.00	4.83
1	VESTA	*	ALTA	39,477	1,465,386.24	8.47
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
CF	DANHOS	13	MEDIA	85,000	2,001,750.00	11.57
CF	FIBRAMQ	12	ALTA	122,000	3,097,580.00	17.91
CF	FIBRAPL	14	ALTA	40,068	2,088,344.16	12.07
CF	FUNO	11	ALTA	171,836	3,624,021.24	20.95
CF	TERRA	13	ALTA	40,000	1,078,800.00	6.24
FE	FCFE	18	MEDIA	65,913	1,806,675.33	10.45
EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES						
1	AMX	L	ALTA	20,500	351,985.00	2.04
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					16,858,000.97	97.46
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					16,858,000.97	97.46
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADOR						
LD	BONDESD	260611	mxAAA	4,400	438,650.23	2.54
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					438,650.23	2.54
TOTAL DE INVERSION EN VALORES					17,296,651.20	100.00

CATEGORÍA ESPECIALIZADA EN FIBRAS

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.440%

Límite de VaR
4.120%

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