

GBMfondos

GBMLATM GBM FONDO DE INVERSIONES LATINOAMERICANAS, S.A. DE C.V., F.I.R.V. CARTERA DE VALORES AL 30 DICIEMBRE, 2022

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS ENERGÉTICAS						
1ASP	PBR	N	ALTA	3,000	623,309.36	10.07
EMPRESAS MATERIALES						
1	CEMEX	CPO	ALTA	51,914	409,082.32	6.61
1	GMEXICO	B	ALTA	7,795	533,255.95	8.61
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1	LASITE	B-1	ALTA	831	7,769.85	0.13
1	VESTA	*	ALTA	8,000	372,080.00	6.01
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	4,750	545,870.00	8.82
1	NEMAK	A	ALTA	12,404	68,966.24	1.11
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1	BACHOCO	B	MEDIA	6,920	580,103.60	9.37
1	FEMSA	UBD	ALTA	5,460	827,899.80	13.37
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1ISP	EWZ	*	ALTA	708	386,330.06	6.24
EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES						
1	AMX	L	ALTA	16,638	294,159.84	4.75
1	TLEVISA	CPO	ALTA	5,638	99,905.36	1.61
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					4,748,732.38	76.70
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					4,748,732.38	76.70
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADOR						
IM	BPAG28	250206	mxAAA	4,192	420,383.45	6.79
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					420,383.45	6.79
OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES						
PRESTAMISTA						
1	CEMEX	CPO	ALTA	6,000	47,280.00	0.76
1	CEMEX	CPO	ALTA	6,000	47,280.00	0.76
1	CEMEX	CPO	ALTA	3,000	23,640.00	0.38
1	NEMAK	A	ALTA	8,000	44,480.00	0.72
1	NEMAK	A	ALTA	2,332	12,965.92	0.21
1	NEMAK	A	ALTA	58,350	324,426.00	5.24
1	NEMAK	A	ALTA	17,645	98,106.20	1.58
1	NEMAK	A	ALTA	17,130	95,242.80	1.54
1	NEMAK	A	ALTA	1,300	7,228.00	0.12
1	NEMAK	A	ALTA	10,000	55,600.00	0.90
1	NEMAK	A	ALTA	12,350	68,666.00	1.11
1	NEMAK	A	ALTA	35,489	197,318.84	3.19
TOTAL OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES					1,022,233.76	16.51
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					6,191,349.59	100.00

CATEGORÍA
ESPECIALIZADA EN ACCIONES LATINOAMERICANAS

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.529%

Límite de VaR
4.690%

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