

GBMfondos

GBMLATM GBM FONDO DE INVERSIONES LATINOAMERICANAS, 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
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS ENERGÉTICAS						
1ASP	PBR	N	ALTA	3,000	675,517.05	8.74
EMPRESAS MATERIALES						
1	CEMEX	CPO	ALTA	66,914	936,126.86	12.11
1	CYDSASA	A	MEDIA	96,251	1,437,027.43	18.59
1	GMEXICO	B	ALTA	9,295	829,950.55	10.74
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	2,383	211,515.08	2.74
1	NEMAK	A	ALTA	99,153	602,850.24	7.80
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1	BACHOCO	B	MEDIA	6,920	503,014.80	6.51
1	FEMSA	UBD	ALTA	5,460	869,887.20	11.25
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1ISP	EWZ	*	ALTA	1,554	894,553.15	11.57
EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES						
1	AMX	L	ALTA	16,638	360,878.22	4.67
1	TLEVISIA	CPO	ALTA	5,638	217,344.90	2.81
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					7,538,665.48	97.52
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					7,538,665.48	97.52
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADOR						
IM	BPAG28	240808	mxAAA	1,923	191,555.66	2.48
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					191,555.66	2.48
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					7,730,221.14	100.00

CATEGORÍA
ESPECIALIZADA EN ACCIONES LATINOAMERICANAS

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.565%

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

Ing. Fernando Castro Tapia