

GBMfondos

GBMPBOL GBM PORTAFOLIO BOLSA, S.A. DE C.V., F.I.R.V. CARTERA DE VALORES AL 31 DICIEMBRE, 2021

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Valor Razonable	%
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					
FONDOS DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA					
51	GBMF2	BF	AAA/2	2,259,519.08	10.29
FONDOS DE INVERSIÓN DE RENTA VARIABLE					
52	GBMALFA	BFF	NA	968,338.04	4.41
52	GBMCRE	BFF	NA	8,272,364.09	37.67
52	GBMFIBR	BFF	NA	324,845.47	1.48
52	GBMMOD	BFF	NA	6,951,423.55	31.65
52	GBMTRV	BFF	NA	3,184,905.92	14.50
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO				21,961,396.15	100.00
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR				21,961,396.15	100.00
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES				21,961,396.15	100.00

CATEGORÍA
ESPECIALIZADA EN ACCIONES A TRAVES DE S.I.

CALIFICACIÓN

VaR Promedio última semana
0.674%

Límite de VaR
1.250%

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

Composición de las Carteras de los Fondos Origen

