

GBMfondos

DYNVAL FONDO SHERPA-HKE DYNAMIC, S.A. de C.V. F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 17 JUNIO, 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	DHT	N	NA	43,013	5,604,933.92	0.81
1ASP	FRO1	N	NA	27,858	4,838,257.23	0.70
1ASP	INSW	N	NA	13,466	5,423,949.74	0.78
1ASP	MRO	*	NA	16,526	4,357,646.49	0.63
1ASP	OGZD	N	NA	96,600	14,785,164.49	2.13
1ASP	OVV	*	NA	7,821	4,718,113.55	0.68
1ASP	OXY1	*	NA	11,767	6,792,882.35	0.98
EMPRESAS MATERIALES						
1ASP	AEM	N	NA	3,370	4,441,701.43	0.64
1ASP	AGI	N	NA	29,500	4,851,872.67	0.70
1ASP	DNMR	*	NA	30,630	14,762,285.94	2.12
1ASP	FCX	*	ALTA	13,559	9,749,544.38	1.40
1ASP	FNV	N	NA	2,113	6,376,922.95	0.92
1ASP	NG	N	NA	66,602	11,608,021.29	1.67
1ASP	OLA	N	NA	56,160	5,115,241.55	0.74
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1	PINFRA	L	MEDIA	120,528	12,326,398.56	1.77
1ASP	DM	*	NA	65,429	16,476,299.05	2.37
1ASP	RWI	N	NA	1,370,000	20,762,998.01	2.98
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1ASP	HMHC	*	NA	120,716	26,472,255.87	3.81
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1ASP	ARYN	N	NA	1,881,527	51,238,159.08	7.37
EMPRESAS DE SALUD						
1ASP	CVS	*	ALTA	21,406	36,883,629.60	5.30
1ASP	VTRS	*	NA	82,622	24,794,602.35	3.56
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
0	CREAL	*	MEDIA	2,808,672	20,896,519.68	3.00
1ASP	BHF	*	NA	11,298	10,483,491.48	1.51
1ASP	BK	*	NA	8,778	8,884,982.93	1.28
1ASP	C	*	NA	4,867	6,855,824.55	0.99
1ASP	FFH	N	ALTA	4,614	42,407,151.72	6.10
1ASP	FIHU	N	NA	178,770	48,638,213.12	6.99
1ASP	KKRC	*	NA	29,791	34,822,235.46	5.01
1E	BBVA	*	MEDIA	60,428	7,856,244.28	1.13
1ISP	EWJ	*	ALTA	4,923	6,930,679.79	1.00
1ISP	GDX	*	ALTA	15,058	10,759,626.82	1.55
1ISP	GDXJ	*	NA	17,846	17,811,604.24	2.56
1ISP	SHV	*	ALTA	7,758	17,535,725.22	2.52
1ISP	SIL	*	NA	7,046	6,379,481.45	0.92
EMPRESAS DE TECNOLOGÍA DE LA INFORMACIÓN						
1ASP	BABA	N	NA	5,150	22,292,266.31	3.20
1ASP	FB	*	NA	1,047	7,207,356.21	1.04
1ASP	MARA	*	NA	56,619	34,816,290.80	5.01
1ASP	SSNC	*	NA	15,802	23,384,166.36	3.36
EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES						
1ASP	DISCA	*	NA	13,854	8,334,921.96	1.20
1ASP	LUMN	*	NA	197,468	57,441,748.90	8.26
1ASP	788	N	NA	2,960,000	8,343,991.36	1.20
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					694,463,403.14	99.84
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					694,463,403.14	99.84
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADOR						
IM	BPAG28	230209	mxAAA	11,399	1,134,403.24	0.16
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					1,134,403.24	0.16
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					695,597,806.38	100.00

CATEGORÍA
DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.488%

Límite de VaR
3.720%

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