

GBMfondos

GBMCRE GBM FONDO DE CRECIMIENTO, S.A. DE C.V. F.I.R.V. CARTERA DE VALORES AL 15 SEPTIEMBRE, 2021

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
TITULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS MATERIALES						
YYSP	CEMEX	CPO	ALTA	6,576	991,673.39	0.12
1	CEMEX	CPO	ALTA	116,000	1,758,560.00	0.21
1	CYDSASA	A	MEDIA	7,497,511	105,789,880.21	12.41
1	GMEXICO	B	ALTA	256,379	22,794,656.89	2.67
1	POCHTEC	B	BAJA	140,827	1,150,556.59	0.13
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1	AGUA	*	MEDIA	89,687	2,834,109.20	0.33
1	ALFA	A	ALTA	294,968	4,120,702.96	0.48
1	GISSA	A	MEDIA	3,788,969	109,501,204.10	12.84
1	GMD	*	MINIMA	3,781,043	46,847,122.77	5.49
1	KUO	B	BAJA	4,500,675	206,130,915.00	24.17
1	PASA	B	BAJA	2,221,708	26,216,154.40	3.07
1	PINFRA	*	ALTA	31,500	4,662,630.00	0.55
1	TMM	A	BAJA	500,000	1,550,000.00	0.18
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	48,900	4,217,136.00	0.49
1	NEMAK	A	ALTA	744,315	4,480,776.30	0.53
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1	BACHOCO	B	MEDIA	142,742	10,856,956.52	1.27
1	BAFAR	B	MEDIA	445,399	17,058,781.70	2.00
1	CULTIBA	B	BAJA	12,163,440	131,486,786.40	15.42
1	FEMSA	UBD	ALTA	63,950	11,345,369.50	1.33
1	MINSA	B	BAJA	3,265,883	28,739,770.40	3.37
EMPRESAS DE SALUD						
1	FRAGUA	B	MEDIA	350,759	108,735,290.00	12.75
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
CF	FNOVA	17	MEDIA	9,971	225,344.60	0.03
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					851,494,376.93	99.85
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					851,494,376.93	99.85
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADOR						
BI	CETES	210923	mxAAA	126,628	1,265,372.35	0.15
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					1,265,372.35	0.15
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					852,759,749.28	100.00

CATEGORÍA
DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
0.931%

Límite de VaR
1.390%

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