

GBMfondos

GBMCRE GBM FONDO DE CRECIMIENTO, 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
TITULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS MATERIALES						
YYSP	CEMEX	CPO	ALTA	6,576	1,022,366.77	0.10
1	CYDSASA	A	BAJA	7,707,902	111,147,946.84	11.32
1	GMEXICO	B	ALTA	229,379	19,873,396.56	2.02
1	POCHTEC	B	BAJA	343,827	2,062,962.00	0.21
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1	AGUA	*	MEDIA	111,766	3,896,162.76	0.40
1	ALFA	A	ALTA	708,310	10,567,985.20	1.08
1	GISSA	A	MEDIA	3,995,988	127,831,656.12	13.02
1	GMD	*	MINIMA	3,781,043	57,169,370.16	5.82
1	KUO	B	MEDIA	4,557,417	209,641,182.00	21.36
1	ORBIA	*	ALTA	111,773	5,947,441.33	0.61
1	PASA	B	MINIMA	2,291,600	26,353,400.00	2.69
1	PINFRA	*	ALTA	31,500	5,158,125.00	0.53
1	TMM	A	BAJA	500,000	1,670,000.00	0.17
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	96,133	8,646,202.02	0.88
1	NMK	A	ALTA	5,160,000	16,408,800.00	1.67
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1	BACHOCO	B	MEDIA	263,726	19,840,106.98	2.02
1	BAFAR	B	BAJA	773,005	29,760,692.50	3.03
1	CULTIBA	B	MEDIA	12,552,505	148,245,084.05	15.10
1	FEMSA	UBD	ALTA	103,099	17,627,867.02	1.80
1	MINSA	B	MINIMA	3,353,600	22,636,800.00	2.31
EMPRESAS DE SALUD						
1	FRAGUA	B	BAJA	410,000	130,277,500.00	13.27
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					975,785,047.31	99.42
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					975,785,047.31	99.42
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADOR						
IM	BPAG28	221110	mxAAA	57,396	5,723,685.44	0.58
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					5,723,685.44	0.58
TOTAL DE INVERSION EN VALORES					981,508,732.75	100.00

CATEGORÍA  
DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN

VaR Promedio  
0.940%

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