

GBMfondos

GBMINF GBM INVERSION EN INFRAESTRUCTURA, 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						
1	CYDSASA	A	BAJA	1,543,230	22,253,376.60	19.21
1	GMEXICO	B	ALTA	117,792	10,205,498.88	8.81
1	POCHTEC	B	BAJA	40,000	240,000.00	0.21
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1	ASUR	B	ALTA	8,000	3,012,240.00	2.60
1	GISSA	A	MEDIA	258,380	8,265,576.20	7.14
1	GMXT	*	ALTA	50,154	1,676,648.22	1.45
1	KUO	B	MEDIA	932,733	42,905,718.00	37.04
1	PASA	B	MINIMA	271,100	3,117,650.00	2.69
1	PINFRA	*	ALTA	12,311	2,015,926.25	1.74
1	VINTE	*	BAJA	465,579	13,292,280.45	11.48
EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES						
1	AMX	L	ALTA	196,000	3,096,800.00	2.67
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					110,081,714.60	95.03
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					110,081,714.60	95.03
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADOR						
IM	BPAG28	221110	mxAAA	26,008	2,593,588.59	2.24
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					2,593,588.59	2.24
OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES						
PRESTAMISTA						
1	PINFRA	*	ALTA	19,300	3,160,375.00	2.73
TOTAL OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES					3,160,375.00	2.73
TOTAL DE INVERSION EN VALORES					115,835,678.19	100.00

CATEGORÍA
ESPECIALIZADA EN ACCIONES

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.050%

Límite de VaR
1.240%

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