

GBMfondos

GBMMOD GBM FONDO DE INVERSION MODELO, 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						
1	CEMEX	CPO	ALTA	1,696,899	25,724,988.84	5.46
1	CYDSASA	A	MEDIA	3,981,175	56,174,379.25	11.92
1	GCC	*	ALTA	27,220	4,212,295.00	0.89
1	GMEXICO	B	ALTA	404,500	35,964,095.00	7.63
1	PE&OLES	*	ALTA	21,500	5,755,980.00	1.22
1	VITRO	A	BAJA	394,290	10,495,999.80	2.23
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1	AGUA	*	MEDIA	212,770	6,723,532.00	1.43
1	ALFA	A	ALTA	520,000	7,264,400.00	1.54
1	GISSA	A	MEDIA	1,731,415	50,037,893.50	10.62
1	GMXT	*	ALTA	319,976	9,615,278.80	2.04
1	KUO	B	BAJA	1,453,408	66,566,086.40	14.12
1	ORBITA	*	ALTA	80,000	4,408,800.00	0.94
1	PINFRA	*	ALTA	85,000	12,581,700.00	2.67
1	PINFRA	L	BAJA	65,366	6,533,950.78	1.39
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	82,614	7,124,631.36	1.51
1	NEMAK	A	ALTA	1,269,319	7,641,300.38	1.62
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1	BACHOCO	B	MEDIA	91,886	6,988,849.16	1.48
1	CULTIBA	B	BAJA	3,729,657	40,317,592.17	8.55
1	FEMSA	UBD	ALTA	209,000	37,078,690.00	7.87
1	GRUMA	B	ALTA	65,000	15,350,400.00	3.26
1	KIMBER	A	ALTA	165,000	5,933,400.00	1.26
EMPRESAS DE SALUD						
1	FRAGUA	B	MEDIA	43,083	13,355,730.00	2.83
EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES						
1	AMX	L	ALTA	1,250,000	23,537,500.00	4.99
1	TLEVISA	CPO	ALTA	190,000	9,498,100.00	2.01
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					468,885,572.44	99.47
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					468,885,572.44	99.47
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADOR						
BI	CETES	211118	mxAAA	252,188	2,501,182.52	0.53
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					2,501,182.52	0.53
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					471,386,754.96	100.00

CATEGORÍA
ESPECIALIZADA EN ACCIONES

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
0.901%

Límite de VaR
2.300%

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