

# GBMfondos

GBMMOD GBM FONDO DE INVERSION MODELO, 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	CEMEX	CPO	ALTA	925,899	14,490,319.35	2.71
1	CYDSASA	A	BAJA	4,076,036	58,776,439.12	11.01
1	GCC	*	ALTA	40,062	5,950,809.48	1.11
1	GMEXICO	B	ALTA	389,500	33,746,280.00	6.32
1	PE&OLES	*	ALTA	21,500	6,092,670.00	1.14
1	VITRO	A	BAJA	394,290	9,462,960.00	1.77
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1	AGUA	*	MEDIA	227,168	7,919,076.48	1.48
1	ALFA	A	ALTA	916,869	13,679,685.48	2.56
1	GISSA	A	MEDIA	1,761,000	56,334,390.00	10.55
1	GMXT	*	ALTA	449,976	15,042,697.68	2.82
1	KUO	B	MEDIA	1,458,355	67,084,330.00	12.57
1	OMA	B	ALTA	67,920	8,957,289.60	1.68
1	ORBIA	*	ALTA	248,665	13,231,464.65	2.48
1	PINFRA	*	ALTA	116,245	19,035,118.75	3.57
1	PINFRA	L	MEDIA	82,366	8,423,570.82	1.58
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	87,981	7,913,011.14	1.48
1	NMK	A	ALTA	3,800,000	12,084,000.00	2.26
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1	BACHOCO	B	MEDIA	175,692	13,217,309.16	2.48
1	CULTIBA	B	MEDIA	3,831,592	45,251,101.52	8.48
1	FEMSA	UBD	ALTA	222,451	38,034,671.98	7.13
1	GRUMA	B	ALTA	81,655	18,324,198.55	3.43
1	WALMEX	*	ALTA	45,000	2,855,250.00	0.53
EMPRESAS DE SALUD						
1	FRAGUA	B	BAJA	53,639	17,043,792.25	3.19
EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES						
1	AMX	L	ALTA	2,363,329	37,340,598.20	7.00
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					530,291,034.21	99.35
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					530,291,034.21	99.35
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADOR						
IM	BPAG28	230209	mxAAA	34,715	3,454,759.94	0.65
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					3,454,759.94	0.65
TOTAL DE INVERSION EN VALORES					533,745,794.15	100.00

CATEGORÍA  
ESPECIALIZADA EN ACCIONES

CALIFICACIÓN

VaR Promedio  
0.946%

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