

GBMfondos

GBMMXOP GBM MEXBOL OPTIMIZADO, S. A. de C. V., F.I.R.V.  
CARTERA DE VALORES AL 17 JUNIO, 2021

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Titulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS MATERIALES						
1	CEMEX	CPO	ALTA	101,532	1,588,975.80	0.40
1	GCC	"	ALTA	121,614	18,064,543.56	4.50
1	GMEXICO	B	ALTA	206,610	17,900,690.40	4.46
1	PE&OLES	"	ALTA	4,034	1,143,154.92	0.28
EMPRESAS INDUSTRIALES						
00	COVAL	A1	NULA	31	0.00	0.00
1	ALFA	A	ALTA	15,955	238,048.60	0.06
1	ASUR	B	ALTA	4,340	1,634,140.20	0.41
1	GAP	B	ALTA	7,130	1,611,380.00	0.40
1	GCARSO	A1	ALTA	29,979	1,936,643.40	0.48
1	OMA	B	ALTA	71,236	9,394,603.68	2.34
1	ORBIA	"	ALTA	30,212	1,607,580.52	0.40
1	PINFRA	"	ALTA	5,289	866,073.75	0.22
1	VESTA	"	ALTA	37,437	1,533,793.89	0.38
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1	ALSEA	"	ALTA	51,986	1,924,521.72	0.48
1	ELEKTRA	"	ALTA	5,017	8,092,822.36	2.02
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	742	66,735.48	0.02
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1	AC	"	ALTA	154,440	17,678,746.80	4.41
1	BIMBO	A	ALTA	37,306	1,642,210.12	0.41
1	CUERVO	"	ALTA	435,557	23,023,543.02	5.74
1	FEMSA	UBD	ALTA	108,718	18,588,603.64	4.63
1	GRUMA	B	ALTA	100,792	22,616,732.72	5.64
1	KIMBER	A	ALTA	228,240	8,342,172.00	2.08
1	KOF	UBL	ALTA	17,271	1,819,845.27	0.45
1	WALMEX	"	ALTA	104,427	6,625,893.15	1.65
EMPRESAS DE SALUD						
1	LAB	B	ALTA	635,007	12,839,841.54	3.20
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1	BOLSA	A	ALTA	289,680	12,661,912.80	3.16
1	GFNBUR	O	ALTA	87,498	1,770,084.54	0.44
1	GFNORTE	O	ALTA	134,249	17,618,838.76	4.39
1	Q	"	ALTA	165,201	15,931,884.44	3.97
1	R	A	ALTA	9,946	1,122,406.10	0.28
41	BBAJIO	O	ALTA	62,593	2,219,547.78	0.55
EMPRESAS DE TECNOLOGÍA DE LA INFORMACIÓN						
1	SITES	B-1	ALTA	73,855	1,403,245.00	0.35
EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES						
1	AMX	"	ALTA	1,687,440	26,661,552.00	6.64
1	MEGA	CPO	ALTA	279,787	20,250,983.06	5.05
1	TLEVISIA	CPO	ALTA	40,141	2,259,536.89	0.56
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					282,683,387.91	70.44
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					282,683,387.91	70.44
OPERACIONES DE REPORTEO						
REPORTADOR						
IM	BPA/G28	221110	mxAAA	336,675	33,574,147.97	8.37
TOTAL OPERACIONES DE REPORTEO					33,574,147.97	8.37
OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES						
PRESTAMISTA						
1	AC	"	ALTA	5,000	572,350.00	0.14
1	AC	"	ALTA	6,500	744,055.00	0.19
1	AC	"	ALTA	2,578	295,103.66	0.07
1	AC	"	ALTA	4,500	515,115.00	0.13
1	AC	"	ALTA	3,189	365,044.83	0.09
1	AC	"	ALTA	2,933	335,740.51	0.08
1	AC	"	ALTA	10,500	1,201,835.00	0.30
1	AC	"	ALTA	1,000	114,470.00	0.03
1	AC	"	ALTA	14,852	1,700,108.44	0.42
1	AC	"	ALTA	25,000	2,961,750.00	0.71
1	ALFA	A	ALTA	13,394	199,838.48	0.05
1	ALFA	A	ALTA	29,171	435,231.32	0.11
1	ALFA	A	ALTA	24,000	358,080.00	0.09
1	ALFA	A	ALTA	44,300	660,956.00	0.16
1	ALFA	A	ALTA	12,000	179,040.00	0.04
1	AMX	L	ALTA	8,444	133,415.20	0.03
1	AMX	L	ALTA	750	11,850.00	0.00
1	AMX	L	ALTA	19,794	312,745.20	0.08
1	AMX	L	ALTA	20,000	316,000.00	0.08
1	AMX	L	ALTA	1,091	17,237.80	0.00
1	AMX	L	ALTA	3,000	47,400.00	0.01
1	AMX	L	ALTA	9,000	142,200.00	0.04
1	ASUR	B	ALTA	30	11,295.90	0.00
1	CEMEX	CPO	ALTA	68,500	1,072,025.00	0.27
1	CEMEX	CPO	ALTA	37,955	593,995.75	0.15
1	CEMEX	CPO	ALTA	32,800	513,320.00	0.13
1	CEMEX	CPO	ALTA	18,000	281,700.00	0.07
1	CEMEX	CPO	ALTA	19,976	312,624.40	0.08
1	CEMEX	CPO	ALTA	91,600	1,433,540.00	0.36
1	CEMEX	CPO	ALTA	230,000	3,599,500.00	0.90
1	CEMEX	CPO	ALTA	15,000	234,750.00	0.06
1	CUERVO	"	ALTA	750	39,645.00	0.01
1	CUERVO	"	ALTA	25,000	1,321,500.00	0.33
1	ELEKTRA	"	ALTA	1,777	2,886,443.16	0.71
1	ELEKTRA	"	ALTA	899	1,450,158.92	0.36
1	ELEKTRA	"	ALTA	800	1,290,464.00	0.32
1	ELEKTRA	"	ALTA	140	225,831.20	0.06
1	ELEKTRA	"	ALTA	95	153,242.60	0.04
1	ELEKTRA	"	ALTA	3	4,839.24	0.00
1	ELEKTRA	"	ALTA	210	338,746.80	0.08
1	ELEKTRA	"	ALTA	132	212,926.56	0.05
1	ELEKTRA	"	ALTA	104	167,760.32	0.04
1	ELEKTRA	"	ALTA	330	532,316.40	0.13
1	ELEKTRA	"	ALTA	500	806,540.00	0.20
1	FEMSA	UBD	ALTA	2,817	481,650.66	0.12
1	FEMSA	UBD	ALTA	240	41,035.20	0.01
1	FEMSA	UBD	ALTA	860	147,042.80	0.04
1	FEMSA	UBD	ALTA	6,000	1,025,880.00	0.26
1	GCC	"	ALTA	25,633	3,807,525.82	0.95
1	GCC	"	ALTA	729	106,285.86	0.03
1	GFNORTE	O	ALTA	7,500	984,300.00	0.25
1	GFNORTE	O	ALTA	6,000	787,440.00	0.20
1	GMEXICO	B	ALTA	850	73,644.00	0.02
1	GMEXICO	B	ALTA	14,822	1,294,178.08	0.32
1	GMEXICO	B	ALTA	6,462	559,867.68	0.14
1	GRUMA	B	ALTA	500	112,205.00	0.03
1	KIMBER	A	ALTA	13,100	478,805.00	0.12
1	KIMBER	A	ALTA	47,991	1,754,071.05	0.44
1	KIMBER	A	ALTA	400,000	14,620,000.00	3.64
1	LAB	B	ALTA	324,084	6,552,878.48	1.63
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	3,500	314,790.00	0.08
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	2,000	179,880.00	0.04
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	2,400	245,856.00	0.05
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	1,621	145,792.74	0.04
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	10,000	899,400.00	0.22
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	1,690	151,998.60	0.04
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	2,200	197,968.00	0.05
1	MEGA	CPO	ALTA	125	9,047.50	0.00
1	OMA	B	ALTA	19,377	2,555,438.76	0.64
1	PE&OLES	"	ALTA	1,000	263,380.00	0.07
1	PE&OLES	"	ALTA	200	56,676.00	0.01
1	PE&OLES	"	ALTA	371	105,133.98	0.03
1	PE&OLES	"	ALTA	195	55,259.10	0.01
1	PINFRA	"	ALTA	5,000	818,750.00	0.20
1	Q	"	ALTA	11,000	1,060,940.00	0.26
1	R	A	ALTA	267	30,130.95	0.01
1	R	A	ALTA	5,500	620,675.00	0.15
1	WALMEX	"	ALTA	9,500	602,775.00	0.15
1	WALMEX	"	ALTA	13,500	856,575.00	0.21
1	WALMEX	"	ALTA	7,000	444,150.00	0.11
1	WALMEX	"	ALTA	3,900	247,455.00	0.06
1	WALMEX	"	ALTA	4,000	253,800.00	0.06
1	WALMEX	"	ALTA	9,750	618,637.50	0.15
1	WALMEX	"	ALTA	5,500	348,975.00	0.09
1	WALMEX	"	ALTA	10,250	650,362.50	0.16
1	WALMEX	"	ALTA	5,000	317,250.00	0.08
1	WALMEX	"	ALTA	21,000	1,332,450.00	0.33
1	WALMEX	"	ALTA	22,500	1,427,625.00	0.36
1	WALMEX	"	ALTA	4,000	253,800.00	0.06
1	WALMEX	"	ALTA	60,000	3,807,000.00	0.95
1	WALMEX	"	ALTA	11,000	697,850.00	0.17
1	WALMEX	"	ALTA	15,000	951,750.00	0.24
1	WALMEX	"	ALTA	24,000	1,522,800.00	0.38
1	WALMEX	"	ALTA	16,300	1,034,235.00	0.26
1	WALMEX	"	ALTA	3,000	190,350.00	0.05
TOTAL OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES					85,060,597.75	21.20
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					401,318,133.63	100.00

CATEGORÍA  
ESPECIALIZADAS EN ACCIONES INDIZADAS AL IPC

CALIFICACIÓN

VaR Promedio  
1.134%

Límite de VaR  
1.750%

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