

GBMfondos

GBMMXOP GBM MEXBOL OPTIMIZADO, 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
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS MATERIALES						
1	CEMEX	CPO	ALTA	430,976	6,533,596.16	1.93
1	GCC	-	ALTA	110,411	17,096,102.25	5.04
1	GMEXICO	B	ALTA	180,890	16,082,029.90	4.75
1	PEÑOLES	-	ALTA	34,751	9,303,537.72	2.75
EMPRESAS INDUSTRIALES						
00	COVAL	A1	NULLA	31	0.00	0.00
1	ALFA	A	ALTA	97,198	1,357,856.06	0.40
1	ASUR	B	ALTA	3,820	1,371,150.80	0.40
1	GAP	B	ALTA	6,374	1,490,814.86	0.44
1	GCARSO	A1	ALTA	5,649	424,748.31	0.13
1	OMA	B	ALTA	10,887	1,318,524.57	0.38
1	ORBIA	-	ALTA	27,761	1,529,908.71	0.45
1	PINFRA	-	ALTA	8,769	1,297,987.38	0.38
1	VESTA	-	ALTA	31,103	1,140,547.01	0.34
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1	ALSEA	-	ALTA	38,942	1,589,223.02	0.47
1	ELEKTRA	-	ALTA	802	1,280,769.94	0.38
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	3,275	282,436.00	0.08
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1	AC	-	ALTA	107,261	13,327,179.25	3.93
1	BIMBO	A	ALTA	28,480	1,594,880.00	0.47
1	CUERVO	-	ALTA	165,311	7,855,552.41	2.26
1	FEMSA	UBD	ALTA	78,892	13,996,229.72	4.13
1	GRUMA	B	ALTA	2,576	608,348.16	0.18
1	KIMBER	A	ALTA	549,356	19,754,841.76	5.83
1	KOF	UBL	ALTA	13,587	1,568,075.67	0.46
1	WALMEX	-	ALTA	14,573	1,042,552.42	0.31
EMPRESAS DE SALUD						
1	LAB	B	ALTA	853,107	17,625,190.62	5.20
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1	BOLSA	A	ALTA	1,637	68,884.96	0.02
1	GFNBUR	O	ALTA	70,291	1,258,911.81	0.37
1	GFNORTE	O	ALTA	147,102	19,233,586.50	5.68
1	Q	-	ALTA	198,397	19,278,236.49	5.69
1	R	A	ALTA	8,699	1,029,787.62	0.30
41	BBAJIO	O	ALTA	25,825	1,008,466.25	0.30
EMPRESAS DE TECNOLOGÍA DE LA INFORMACIÓN						
1	SITES	B-1	ALTA	74,527	1,306,458.31	0.39
EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES						
1	AMX	-	ALTA	1,166,691	21,968,791.53	6.48
1	MEGA	CPO	ALTA	239,046	16,286,203.98	4.81
1	TLEVISIA	CPO	ALTA	25,410	1,270,245.90	0.37
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					221,972,556.05	65.51
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					221,972,556.05	65.51
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADOR						
01	CETES	210923	mxAAA	296,847	2,966,342.24	0.88
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					2,966,342.24	0.88
OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES						
PRESTAMISTA						
1	AC	-	ALTA	2,000	248,500.00	0.07
1	AC	-	ALTA	3,290	408,782.50	0.12
1	AC	-	ALTA	8,400	1,043,700.00	0.31
1	AC	-	ALTA	2,578	320,316.50	0.09
1	AC	-	ALTA	6,500	807,625.00	0.24
1	AC	-	ALTA	4,574	568,319.50	0.17
1	AC	-	ALTA	1,200	149,100.00	0.04
1	AC	-	ALTA	2,933	364,425.25	0.11
1	AC	-	ALTA	4,500	559,125.00	0.17
1	AC	-	ALTA	14,852	1,845,361.00	0.54
1	AC	-	ALTA	1,500	186,375.00	0.06
1	AC	-	ALTA	10,500	1,304,625.00	0.39
1	AC	-	ALTA	19,456	2,417,408.00	0.71
1	AMX	L	ALTA	750	750.00	0.00
1	AMX	L	ALTA	6,119	115,220.77	0.03
1	AMX	L	ALTA	50,000	941,500.00	0.28
1	AMX	L	ALTA	2,000	37,600.00	0.01
1	AMX	L	ALTA	280,000	4,895,800.00	1.44
1	BIMBO	A	ALTA	4,000	224,000.00	0.07
1	BOLSA	A	ALTA	31,200	1,312,896.00	0.39
1	CEMEX	CPO	ALTA	19,976	302,836.16	0.09
1	CEMEX	CPO	ALTA	52,800	697,248.00	0.15
1	CEMEX	CPO	ALTA	25,000	379,000.00	0.11
1	CEMEX	CPO	ALTA	37,955	575,387.80	0.17
1	CEMEX	CPO	ALTA	25,000	379,000.00	0.11
1	CEMEX	CPO	ALTA	3,000	45,480.00	0.01
1	CEMEX	CPO	ALTA	50,000	758,000.00	0.22
1	CEMEX	CPO	ALTA	10,000	151,600.00	0.04
1	CEMEX	CPO	ALTA	48,500	735,260.00	0.22
1	CUERVO	-	ALTA	1,492	89,944.52	0.02
1	CUERVO	-	ALTA	183,700	6,507,147.00	2.51
1	CUERVO	-	ALTA	475	21,997.25	0.01
1	CUERVO	-	ALTA	15,000	694,650.00	0.21
1	ELEKTRA	-	ALTA	95	151,712.15	0.04
1	ELEKTRA	-	ALTA	3	4,790.91	0.00
1	ELEKTRA	-	ALTA	132	210,800.04	0.06
1	ELEKTRA	-	ALTA	104	166,694.88	0.05
1	ELEKTRA	-	ALTA	83	132,548.51	0.04
1	ELEKTRA	-	ALTA	800	1,277,576.00	0.38
1	ELEKTRA	-	ALTA	899	1,435,676.03	0.42
1	ELEKTRA	-	ALTA	185	295,439.45	0.09
1	ELEKTRA	-	ALTA	330	527,300.10	0.16
1	ELEKTRA	-	ALTA	10,466	16,713,888.02	4.93
1	ELEKTRA	-	ALTA	65	103,803.05	0.03
1	ELEKTRA	-	ALTA	1,777	2,837,615.69	0.84
1	ELEKTRA	-	ALTA	800	1,277,576.00	0.38
1	FEMSA	UBD	ALTA	3,000	532,230.00	0.16
1	FEMSA	UBD	ALTA	2,817	499,763.97	0.15
1	FEMSA	UBD	ALTA	1,250	221,762.50	0.07
1	FEMSA	UBD	ALTA	2,940	42,578.40	0.01
1	FEMSA	UBD	ALTA	11,500	2,040,215.00	0.60
1	GCARSO	A1	ALTA	16,611	1,248,981.09	0.37
1	GCC	-	ALTA	101	15,629.75	0.00
1	GCC	-	ALTA	18,861	2,918,739.75	0.86
1	GFNORTE	O	ALTA	4,000	523,000.00	0.15
1	GFNORTE	O	ALTA	7,500	980,625.00	0.29
1	GRUMA	B	ALTA	500	118,080.00	0.03
1	GRUMA	B	ALTA	80,000	16,852,800.00	5.58
1	GRUMA	B	ALTA	12,387	2,925,313.92	0.86
1	KIMBER	A	ALTA	68,060	2,447,437.60	0.72
1	KIMBER	A	ALTA	7,829	281,530.84	0.08
1	LAB	B	ALTA	15,529	320,629.14	0.09
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	10,000	862,400.00	0.25
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	1,230	106,075.20	0.03
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	1,700	146,608.00	0.04
1	MEGA	CPO	ALTA	14,407	981,548.91	0.29
1	MEGA	CPO	ALTA	270	18,385.10	0.01
1	MEGA	CPO	ALTA	7,000	476,810.00	0.14
1	PEÑOLES	-	ALTA	371	99,324.12	0.03
1	R	A	ALTA	3,900	461,682.00	0.14
1	VESTA	-	ALTA	5,014	193,893.38	0.06
1	VESTA	-	ALTA	300	11,001.00	0.00
1	WALMEX	-	ALTA	3,600	257,544.00	0.08
1	WALMEX	-	ALTA	5,500	393,470.00	0.12
1	WALMEX	-	ALTA	1,850	132,349.00	0.04
1	WALMEX	-	ALTA	8,400	600,836.00	0.18
1	WALMEX	-	ALTA	16,300	1,166,102.00	0.34
1	WALMEX	-	ALTA	17,500	1,251,950.00	0.37
1	WALMEX	-	ALTA	11,000	796,940.00	0.23
1	WALMEX	-	ALTA	7,000	500,780.00	0.15
1	WALMEX	-	ALTA	7,500	536,550.00	0.16
1	WALMEX	-	ALTA	45,000	3,219,300.00	0.95
1	WALMEX	-	ALTA	1,500	107,310.00	0.03
1	WALMEX	-	ALTA	3,000	214,620.00	0.06
1	WALMEX	-	ALTA	3,900	279,006.00	0.08
1	WALMEX	-	ALTA	1,612	115,322.48	0.03
1	WALMEX	-	ALTA	3,150	225,351.00	0.07
1	WALMEX	-	ALTA	35,000	2,503,900.00	0.74
1	WALMEX	-	ALTA	75,000	5,365,500.00	1.58
1	WALMEX	-	ALTA	2,850	203,889.00	0.06
1	WALMEX	-	ALTA	15,500	1,108,870.00	0.33
1	WALMEX	-	ALTA	4,000	286,160.00	0.08
1	WALMEX	-	ALTA	9,500	679,630.00	0.20
41	BBAJIO	O	ALTA	15,200	593,560.00	0.18
TOTAL OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES					113,902,847.73	33.62
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					338,841,546.02	100.00

CATEGORÍA
ESPECIALIZADAS EN ACCIONES INDIZADAS AL IPC

CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
	1.134%	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