

# GBMfondos

## GBMAGR GBM FONDO DE INVERSION TOTAL, S.A. DE C.V., F.I.R.V. CARTERA DE VALORES AL 02 SEPTIEMBRE, 2021

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
<b>TITULOS PARA NEGOCIAR</b>						
<b>INVERSION EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO</b>						
<b>EMPRESAS MATERIALES</b>						
1	CEMEX	CPO	ALTA	6,065,029	98,010,868.64	1.13
1	CYDSASA	A	MEDIA	1,562,906	22,036,974.60	0.25
1	ICH	B	MEDIA	1,459,287	233,485,920.00	2.69
1	LAMOSAS	*	MEDIA	8,909,894	619,237,633.00	7.12
1	SIMEC	B	MEDIA	1,490,257	239,931,377.00	2.76
1	VITRO	A	BAJA	167,889	4,197,225.00	0.05
<b>EMPRESAS INDUSTRIALES</b>						
1	AEROMEX	*	MEDIA	25,508,375	144,377,402.50	1.66
1	AGUA	*	MEDIA	3,690,513	124,185,762.45	1.43
1	ALFA	A	ALTA	27,000	380,700.00	0.00
1	ARA	*	MEDIA	327,056	1,488,104.80	0.02
1	CERAMIC	B	BAJA	3,097,524	164,168,772.00	1.89
1	DINE	A	MINIMA	1,559,737	29,635,003.00	0.34
1	DINE	B	MINIMA	6,172,219	117,580,771.95	1.35
1	GISSA	A	MEDIA	3,646,440	105,710,295.60	1.22
1	GSANBOR	B-1	BAJA	563,516	12,679,110.00	0.15
1	KUO	A	MINIMA	2,553,287	125,985,201.23	1.45
1	KUO	B	BAJA	25,882,775	1,191,384,133.25	13.70
1	ORBITA	*	ALTA	1,742,780	102,039,769.00	1.17
1	PASA	B	BAJA	42,992	507,305.60	0.01
<b>EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO</b>						
1	CIE	B	MINIMA	17,685,300	143,427,783.00	1.65
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	1,087,137	97,103,076.84	1.12
1	LIVEPOL	1	MINIMA	967,218	94,259,711.76	1.08
1	NMK	A	ALTA	8,025,407	23,674,950.65	0.27
1	POSADAS	A	MINIMA	24,854,350	631,300,490.00	7.26
<b>EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE</b>						
1	BACHOCO	B	MEDIA	7,672,153	566,204,891.40	6.51
1	BAFAR	B	MEDIA	81,485	3,259,400.00	0.04
1	CHDRAUI	B	MEDIA	3,186,130	99,885,175.50	1.15
1	CULTIBA	B	BAJA	433,135	4,716,840.15	0.05
1	GIGANTE	*	MINIMA	12,842,467	333,904,142.00	3.84
1	HERDEZ	*	MEDIA	10,315,207	432,929,237.79	4.98
1	LACOMER	UBC	MEDIA	28,988,350	1,112,572,873.00	12.79
1	MINSA	B	BAJA	2,747	24,448.30	0.00
1	SORIANA	B	MEDIA	23,468,814	578,740,953.24	6.66
<b>EMPRESAS DE SALUD</b>						
1	FRAGUA	B	MEDIA	829,969	275,549,708.00	3.17
1	MEDICA	B	BAJA	23,293	966,659.50	0.01
<b>EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS</b>						
00	POP	N	NULA	27,984,568	27.98	0.00
1	GBM	O	MEDIA	27,368,689	437,899,024.00	5.04
1	GENEREA	*	ALTA	16,674,486	186,587,498.34	2.15
<b>EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES</b>						
1	AXTEL	CPO	MEDIA	11,294,826	63,138,077.34	0.73
1	RCENTRO	A	MINIMA	854,779	2,816,490.82	0.03
<b>TOTAL INVERSION EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO</b>					<b>8,425,983,789.23</b>	<b>96.90</b>
<b>TOTAL TITULOS PARA NEGOCIAR</b>					<b>8,425,983,789.23</b>	<b>96.90</b>
<b>OPERACIONES DE REPORTE</b>						
<b>REPORTADOR</b>						
BI	CETES	211216	mxAAA	27,359,150	269,575,839.84	3.10
<b>TOTAL OPERACIONES DE REPORTE</b>					<b>269,575,839.84</b>	<b>3.10</b>
<b>TOTAL DE INVERSION EN VALORES</b>					<b>8,695,559,629.07</b>	<b>100.00</b>

### CATEGORÍA ESPECIALIZADA EN ACCIONES

CALIFICACIÓN

VaR Promedio  
0.766%

Límite de VaR  
8.530%

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 período 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