

GBMfondos

GBMCRE GBM FONDO DE CRECIMIENTO, 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
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS MATERIALES						
YYSP	CEMEX	CPO	ALTA	6,576	1,055,676.06	0.12
1	CEMEX	CPO	ALTA	116,000	1,874,560.00	0.21
1	CYDSASA	A	MEDIA	7,551,925	106,482,142.50	12.06
1	GMEXICO	B	ALTA	256,379	23,138,204.75	2.62
1	POCHTEC	B	BAJA	142,520	1,204,294.00	0.14
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1	AGUA	*	MEDIA	92,359	3,107,880.35	0.35
1	ALFA	A	ALTA	464,968	6,556,048.80	0.74
1	GISSA	A	MEDIA	3,837,347	111,244,689.53	12.60
1	GMD	*	MINIMA	3,781,043	47,225,227.07	5.35
1	KUO	B	BAJA	4,503,502	207,296,197.06	23.48
1	PASA	B	BAJA	2,291,600	27,040,880.00	3.06
1	PINFRA	*	ALTA	31,500	4,765,320.00	0.54
1	TMM	A	BAJA	500,000	1,595,000.00	0.18
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	48,900	4,367,748.00	0.49
1	NMK	A	ALTA	2,495,100	7,360,545.00	0.83
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1	BACHOCO	B	MEDIA	180,242	13,301,859.60	1.51
1	BAFAR	B	MEDIA	455,399	18,215,980.00	2.06
1	CULTIBA	B	BAJA	12,203,957	132,901,091.73	15.05
1	FEMSA	UBD	ALTA	79,000	13,528,750.00	1.53
1	MINSA	B	BAJA	3,283,658	29,224,556.20	3.31
EMPRESAS DE SALUD						
1	FRAGUA	B	MEDIA	350,759	116,451,988.00	13.19
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					877,938,618.65	99.43
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					877,938,618.65	99.43
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADOR						
BI	CETES	211216	mxAAA	508,277	5,008,167.25	0.57
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					5,008,167.25	0.57
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					882,946,785.90	100.00

CATEGORÍA DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
0.927%

Límite de VaR
1.390%

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