

GBMfondos

GBM102 GBM 102, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 30 JULIO, 2021

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Valor Razonable	%
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					
EMPRESAS ENERGÉTICAS					
1ASP	FEC	N	NA	244.00	0.00
EMPRESAS MATERIALES					
1	CYDSASA	A	BAJA	54,016,523.52	4.93
1	ELEMENT	*	MEDIA	2,156,220.56	0.20
1	VITRO	A	BAJA	20,940,672.50	1.91
EMPRESAS INDUSTRIALES					
1	AGUA	*	MEDIA	95,018,983.56	8.68
1	ALFA	A	ALTA	59,634,952.64	5.45
1	ARA	*	MEDIA	21,992,858.69	2.01
1	DINE	B	MINIMA	5,404,817.00	0.49
1	GISSA	A	MEDIA	77,913,069.50	7.11
1	GMD	*	MINIMA	108,741,265.50	9.93
1	KUO	B	BAJA	147,217,536.00	13.44
1	PINFRA	L	MEDIA	39,397,500.00	3.60
1	TMM	A	BAJA	5,443,642.67	0.50
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO					
1	NMK	A	ALTA	12,587,852.80	1.15
1	POSADAS	A	MINIMA	5,180.00	0.00
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE					
1	BAFAR	B	BAJA	35,385,273.00	3.23
1	CULTIBA	B	BAJA	45,460,418.22	4.15
1	MINSA	B	MINIMA	23,773,725.55	2.17
1	SORIANA	B	MEDIA	830,973.56	0.08
EMPRESAS DE SALUD					
1	FRAGUA	B	MEDIA	61,782,678.50	5.64
1	MEDICA	B	BAJA	4,907,851.50	0.45
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS					
0	FINDEP	*	MINIMA	1,722,839.50	0.16
1	GBM	O	MEDIA	17,172,856.47	1.57
1ISP	IBTS	N	ALTA	14,572,393.96	1.33
EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES					
1	AXTEL	CPO	MEDIA	71,166,878.02	6.50
FONDOS DE INVERSIÓN DE RENTA VARIABLE					
52	GBMV1	BGBMM	NA	160,056,321.84	14.61
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO				1,087,303,529.06	99.28
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR				1,087,303,529.06	99.28
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADOR					
BI	CETES	220113	mxAAA	7,915,447.31	0.72
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE				7,915,447.31	0.72
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES				1,095,218,976.37	100.00

CATEGORÍA
DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN

VaR Promedio última semana
0.757%

Límite de VaR
3.400%

Para llevar a cabo la estimación del Valor en Riesgo (VaR) de mercado para los 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

