

GBMfondos

GBM103 GBM 103, 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 MATERIALES					
1	CYDSASA	A	BAJA	16,504,947.36	0.97
1	GMEXICO	B	ALTA	421,207,780.00	24.80
1	VITRO	A	BAJA	2,241,057.50	0.13
EMPRESAS INDUSTRIALES					
1	AGUA	*	MEDIA	251,192,875.14	14.79
1	ARA	*	MEDIA	89,589,586.68	5.27
1	GISSA	A	MEDIA	120,194,033.00	7.08
1	GMD	*	MINIMA	111,958,110.60	6.59
1	GMXT	*	ALTA	37,607,005.26	2.21
1	KUO	B	BAJA	212,797,811.00	12.53
1	PINFRA	L	MEDIA	57,498,411.00	3.39
1	TMM	A	BAJA	11,395,415.38	0.67
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO					
1	CMR	B	MINIMA	14,391,418.14	0.85
1	POSADAS	A	MINIMA	5,180.00	0.00
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE					
1	BAFAR	B	BAJA	35,581,815.50	2.09
1	CULTIBA	B	BAJA	135,515,463.09	7.98
1	MINSa	B	MINIMA	26,082,208.60	1.54
EMPRESAS DE SALUD					
1	FRAGUA	B	MEDIA	80,720,328.50	4.75
1	MEDICA	B	BAJA	811,974.50	0.05
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS					
1	GBM	O	MEDIA	40,273,003.76	2.37
FONDOS DE INVERSIÓN DE RENTA VARIABLE					
52	GBMV1	BGBMM	NA	32,697,018.85	1.92
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NE				1,698,265,443.86	99.98
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR				1,698,265,443.86	99.98
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADOR					
BI	CETES	220113	mxAAA	372,785.54	0.02
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE				372,785.54	0.02
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES				1,698,638,229.40	100.00

CATEGORÍA
DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN

VaR Promedio última semana
1.166%

Limite de VaR
3.400%

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

