

GBMfondos

GBM102 GBM 102, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 19 AGOSTO, 2021

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Valor Razonable	%	
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS ENERGÉTICAS						
1	IASP	FEC	N	201.75	0.00	
EMPRESAS MATERIALES						
1		CYDSASA	A	BAJA	54,250,699.20	5.05
1		ELEMENT	*	MEDIA	2,300,780.16	0.21
1		VITRO	A	BAJA	18,953,212.31	1.76
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1		AGUA	*	MEDIA	99,072,893.54	9.22
1		ALFA	A	ALTA	52,239,589.12	4.86
1		ARA	*	MEDIA	20,876,941.97	1.94
1		DINE	B	MINIMA	5,956,481.08	0.55
1		GISSA	A	MEDIA	76,988,677.15	7.17
1		GMD	*	MINIMA	103,489,136.35	9.63
1		KUO	B	BAJA	146,872,984.32	13.67
1		PINFRA	L	BAJA	36,911,250.00	3.44
1		TMM	A	BAJA	4,835,327.30	0.45
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1		NMK	A	ALTA	11,407,741.60	1.06
1		POSADAS	A	MINIMA	5,194.00	0.00
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1		BAFAR	B	BAJA	36,019,450.62	3.35
1		CULTIBA	B	BAJA	44,480,139.66	4.14
1		MINSA	B	BAJA	23,379,685.90	2.18
1		SORIANA	B	MEDIA	988,919.96	0.09
EMPRESAS DE SALUD						
1		FRAGUA	B	MEDIA	61,679,863.15	5.74
1		MEDICA	B	BAJA	6,183,120.00	0.58
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
0		FINDEP	*	MINIMA	1,744,786.50	0.16
1		GBM	O	MEDIA	18,123,975.00	1.69
1	ISP	IBTS	N	ALTA	14,775,876.92	1.38
EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES						
1		AXTEL	CPO	MEDIA	66,570,973.96	6.20
FONDOS DE INVERSIÓN DE RENTA VARIABLE						
52		GBMV1	BGBMM	NA	161,810,452.76	15.06
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO				1,069,918,354.28	99.59	
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR				1,069,918,354.28	99.59	
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADOR						
BI		CETES	211216	mxAAA	4,406,098.67	0.41
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE				4,406,098.67	0.41	
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES				1,074,324,452.95	100.00	

CATEGORÍA
DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN

VaR Promedio última semana
0.759%

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

