

# GBMfondos

GBM103 GBM 103, S.A. DE C.V., F.I.R.V.  
CARTERA DE VALORES AL 19 AGOSTO, 2021

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Valor Razonable	%
<b>INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO</b>					
<b>EMPRESAS MATERIALES</b>					
1	CYDSASA	A	BAJA	16,576,500.60	0.99
1	GMEXICO	B	ALTA	399,041,380.00	23.87
1	VITRO	A	BAJA	2,028,360.77	0.12
<b>EMPRESAS INDUSTRIALES</b>					
1	AGUA	*	MEDIA	261,909,821.01	15.67
1	ARA	*	MEDIA	85,043,814.84	5.09
1	GISSA	A	MEDIA	118,768,002.10	7.11
1	GMD	*	MINIMA	106,550,610.02	6.37
1	GMXT	*	ALTA	35,819,387.66	2.14
1	KUO	B	BAJA	212,299,773.57	12.70
1	PINFRA	L	BAJA	53,869,870.50	3.22
1	TMM	A	BAJA	10,122,002.20	0.61
<b>EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO</b>					
1	CMR	B	MINIMA	13,955,314.56	0.83
1	POSADAS	A	MINIMA	5,194.00	0.00
<b>EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE</b>					
1	BAFAR	B	BAJA	36,219,515.57	2.17
1	CULTIBA	B	BAJA	132,593,296.77	7.93
1	MINSA	B	BAJA	25,649,906.80	1.53
<b>EMPRESAS DE SALUD</b>					
1	FRAGUA	B	MEDIA	80,585,998.15	4.82
1	MEDICA	B	BAJA	1,022,960.00	0.06
<b>EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS</b>					
1	GBM	O	MEDIA	40,785,990.00	2.44
<b>FONDOS DE INVERSIÓN DE RENTA VARIABLE</b>					
52	GBMV1	BGBMM	NA	34,301,307.75	2.05
<b>TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO</b>				1,667,149,006.87	99.74
<b>TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>				1,667,149,006.87	99.74
<b>OPERACIONES DE REPORTE</b>					
<b>REPORTADOR</b>					
BI	CETES	211216	mxAAA	4,351,020.10	0.26
<b>TOTAL OPERACIONES DE REPORTE</b>				4,351,020.10	0.26
<b>TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES</b>				1,671,500,026.97	100.00

**CATEGORÍA**  
DISCRECIONAL

**CALIFICACIÓN**

**VaR Promedio última semana**  
1.174%

**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

