

GBMfondos

GBM104 GBM 104, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 13 ENERO, 2022

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Valor Razorable	%
INVERSION EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					
EMPRESAS MATERIALES					
1	CEMEX	CPO	ALTA	370,783,671.60	4.61
1	CYDSASA	A	MEDIA	81,448,524.60	1.01
1	ICH	B	MEDIA	400,219,245.00	4.98
1	LAMOSA	*	MEDIA	602,700,673.56	7.50
1	SIMEC	B	MEDIA	470,853,620.48	5.86
1	VITRO	A	BAJA	4,283,221.00	0.05
EMPRESAS INDUSTRIALES					
1	AGUA	*	MEDIA	89,806,102.75	1.12
1	ARA	*	MEDIA	4,408,524.54	0.05
1	CERAMIC	B	BAJA	106,030,246.20	1.32
1	DINE	A	MINIMA	25,603,305.00	0.32
1	DINE	B	MINIMA	44,851,830.00	0.56
1	GISSA	A	MEDIA	246,163,843.63	3.06
1	GSANBOR	B-1	BAJA	3,935,913.25	0.05
1	KUO	A	MINIMA	79,240,395.06	0.99
1	KUO	B	MEDIA	827,362,260.00	10.29
1	ORBIA	*	ALTA	24,294,990.16	0.30
1	PASA	B	BAJA	8,995,363.65	0.11
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO					
1	CIE	B	BAJA	119,188,904.00	1.48
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	483,527,971.20	6.01
1	LIVEPOL	B	BAJA	123,021,697.50	1.53
1	NEMAK	A	ALTA	8,744,584.92	0.11
1	POSADAS	A	MINIMA	248,903,628.40	3.10
1	SPORT	S	BAJA	10,530,367.80	0.13
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE					
1	BACHOCO	B	ALTA	89,665,824.76	1.12
1	BAFAR	B	MEDIA	6,495,090.00	0.08
1	CHDRAUI	B	MEDIA	11,944,800.00	0.15
1	CULTIBA	B	BAJA	22,184,880.00	0.28
1	GIGANTE	*	MINIMA	110,870,746.20	1.38
1	GRUMA	B	ALTA	58,192,699.81	0.72
1	HERDEZ	*	MEDIA	174,942,361.86	2.18
1	LACOMER	UBC	ALTA	1,189,991,737.27	14.80
1	SORIANA	B	MEDIA	738,961,200.26	9.19
1	WALMEX	*	ALTA	79,035,000.00	0.98
EMPRESAS DE SALUD					
1	FRAGUA	B	MEDIA	10,810,477.14	0.13
1	MEDICA	B	BAJA	323,102.40	0.00
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS					
1	GBM	O	MEDIA	474,908,434.50	5.91
1	GENTERA	*	ALTA	213,886,979.46	2.66
1	GFNORTE	O	ALTA	33,384,395.12	0.42
EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES					
1	AMX	L	ALTA	156,450,000.00	1.95
1	AXTEL	CPO	MEDIA	82,292,196.60	1.02
1	RCENTRO	A	MINIMA	522,268.15	0.01
FONDOS DE INVERSIÓN DE RENTA VARIABLE					
52	GBMCRE	BFF	NA	19,108,456.91	0.24
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO				7,858,870,834.74	97.75
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR				7,858,870,834.74	97.75
OPERACIONES DE REPORTE					
REPORTADOR					
IS	BPA182	240905	mxAAA	181,103,226.95	2.25
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE				181,103,226.95	2.25
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES				8,039,974,061.69	100.00

CATEGORÍA DISCRECIONAL CALIFICACIÓN

VaR Promedio última semana 0.795% Límite de VaR 3.000%

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

