

# GBMfondos

GBM107 GBM 107, S.A. DE C.V., F.I.R.V.  
CARTERA DE VALORES AL 31 MARZO, 2021

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
<b>TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>						
<b>INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO</b>						
<b>EMPRESAS ENERGÉTICAS</b>						
1	IENOVA	*	ALTA	203	16,012.64	4.35
<b>EMPRESAS MATERIALES</b>						
1	CEMEX	CPO	ALTA	1,637	23,605.54	6.41
1	GMEXICO	B	ALTA	526	56,523.96	15.35
<b>EMPRESAS INDUSTRIALES</b>						
1	ALFA	A	ALTA	413	4,873.40	1.32
1	ORBIA	*	ALTA	384	20,954.88	5.69
1	PINFRA	*	ALTA	198	30,959.28	8.41
<b>EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO</b>						
1	NMK	A	ALTA	412	1,058.84	0.29
<b>EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE</b>						
1	KOF	UBL	ALTA	396	37,386.36	10.15
1	WALMEX	*	ALTA	1,187	76,525.89	20.78
<b>EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS</b>						
1	GFNORTE	O	ALTA	159	18,305.67	4.97
<b>EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES</b>						
1	AMX	L	ALTA	4,477	62,498.92	16.97
<b>TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO</b>					<b>348,705.38</b>	<b>94.71</b>
<b>TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>					<b>348,705.38</b>	<b>94.71</b>
<b>OPERACIONES DE REPORTE</b>						
<b>REPORTADOR</b>						
LD	BONDESD	240627	mxAAA	195	19,479.22	5.29
<b>TOTAL OPERACIONES DE REPORTE</b>					<b>19,479.22</b>	<b>5.29</b>
<b>TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES</b>					<b>368,184.60</b>	<b>100.00</b>

**CATEGORÍA**  
DISCRECIONAL

**CALIFICACIÓN**

**VaR Promedio**  
1.861%

**Límite de VaR**  
3.410%

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

Ing. Fernando Castro Tapia