

GBMfondos

GBMIND GBM Indexado México, 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
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS ENERGÉTICAS						
1	IENOVA	*	ALTA	264	20,824.32	3.81
EMPRESAS MATERIALES						
1	CEMEX	CPO	ALTA	917	13,223.14	2.42
1	GMEXICO	B	ALTA	343	36,858.78	6.74
1	PE&OLES	*	ALTA	32	8,436.16	1.54
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1	ALFA	A	ALTA	287	3,386.60	0.62
1	GCARSO	A1	ALTA	123	6,873.24	1.26
1	ORBIA	*	ALTA	89	4,856.73	0.89
1	PINFRA	*	ALTA	80	12,508.80	2.29
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1	ELEKTRA	*	ALTA	21	28,859.88	5.28
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	71	5,085.73	0.93
1	NMK	A	ALTA	288	740.16	0.14
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1	AC	*	ALTA	160	16,136.00	2.95
1	CUERVO	*	ALTA	143	6,686.68	1.22
1	FEMSA	UBD	ALTA	547	84,287.23	15.42
1	GRUMA	B	ALTA	82	19,793.98	3.62
1	KIMBER	A	ALTA	472	16,486.96	3.02
1	KOF	UBL	ALTA	191	18,032.31	3.30
1	WALMEX	*	ALTA	1,272	82,005.84	15.01
EMPRESAS DE SALUD						
1	LAB	B	ALTA	199	4,101.39	0.75
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1	BOLSA	A	ALTA	162	6,682.50	1.22
1	GENTERA	*	ALTA	330	3,012.90	0.55
1	GFINBUR	O	ALTA	240	4,456.80	0.82
1	R	A	ALTA	39	3,740.88	0.68
41	BBAJIO	O	ALTA	217	5,982.69	1.09
41	BSMX	B	ALTA	206	4,639.12	0.85
EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES						
1	AMX	L	ALTA	6,276	87,612.96	16.03
1	MEGA	CPO	ALTA	108	7,909.92	1.45
1	TLEVISIA	CPO	ALTA	505	18,371.90	3.36
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					531,593.60	97.28
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					531,593.60	97.28
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADOR						
LD	BONDESD	240627	mxAAA	149	14,884.12	2.72
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					14,884.12	2.72
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					546,477.72	100.00

CATEGORÍA
DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.623%

Límite de VaR
2.010%

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