

# GBMfondos

## GBMMILA GBM FONDO DE INVERSIÓN EN EL MERCADO INTEGRADO LATINOAMERICANO EN ACCIONES DE INFRAESTRUCTURA, S.A. DE C.V., F.I.R.V CARTERA DE VALORES AL 30 JUNIO, 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 MATERIALES</b>						
1	CEMEX	CPO	ALTA	4,500	75,690.00	17.43
1	GCC	*	ALTA	400	64,380.00	14.83
1	GMEXICO	B	ALTA	860	80,633.60	18.57
<b>EMPRESAS INDUSTRIALES</b>						
1	ALFA	A	ALTA	1,530	22,888.80	5.27
1	ARA	*	MEDIA	5,881	27,111.41	6.24
1	GMXT	*	ALTA	914	30,801.80	7.09
1	ORBIA	*	ALTA	588	30,658.32	7.06
<b>EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO</b>						
1	NMK	A	ALTA	1,530	4,972.50	1.15
<b>EMPRESAS DE TECNOLOGÍA DE LA INFORMACIÓN</b>						
1	SITES	B-1	ALTA	1,643	30,296.92	6.98
<b>EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES</b>						
1	AMX	L	ALTA	3,794	56,910.00	13.11
<b>TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO</b>					<b>424,343.35</b>	<b>97.72</b>
<b>TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>					<b>424,343.35</b>	<b>97.72</b>
<b>OPERACIONES DE REPORTE</b>						
<b>REPORTADOR</b>						
IM	BPAG28	230810	mxAAA	99	9,879.73	2.28
<b>TOTAL OPERACIONES DE REPORTE</b>					<b>9,879.73</b>	<b>2.28</b>
<b>TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES</b>					<b>434,223.08</b>	<b>100.00</b>

**CATEGORÍA**  
ESPECIALIZADA EN ACCIONES LATINOAMERICANAS

**CALIFICACIÓN**

**VaR Promedio**  
1.392%

**Límite de VaR**  
4.690%

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