

GBMfondos

GBMMOMX GBM Momentum 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	23,085	1,820,944.80	2.36
EMPRESAS MATERIALES						
1	CEMEX	CPO	ALTA	213,651	3,080,847.42	4.00
1	GCC	*	ALTA	6,074	861,657.64	1.12
1	GMEXICO	B	ALTA	46,672	5,015,373.12	6.50
1	PE&OLES	*	ALTA	8,929	2,353,952.27	3.05
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1	ALFA	A	ALTA	296,823	3,502,511.40	4.54
1	GAP	B	ALTA	10,000	2,136,600.00	2.77
1	GMXT	*	ALTA	67,383	2,214,205.38	2.87
1	OMA	B	ALTA	20,000	2,570,400.00	3.33
1	ORBIA	*	ALTA	30,994	1,691,342.58	2.19
1	PINFRA	*	ALTA	25,189	3,938,552.04	5.11
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1	NMK	A	ALTA	1,257,233	3,231,088.81	4.19
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1	AC	*	ALTA	10,796	1,088,776.60	1.41
1	BACHOCO	B	MEDIA	29,011	1,973,908.44	2.56
1	BIMBO	A	ALTA	20,000	858,000.00	1.11
1	CUERVO	*	ALTA	74,567	3,486,752.92	4.52
1	FEMSA	UBD	ALTA	16,005	2,466,210.45	3.20
1	GRUMA	B	ALTA	12,584	3,037,651.76	3.94
1	KIMBER	A	ALTA	27,193	949,851.49	1.23
1	LALA	B	MEDIA	128,016	1,747,418.40	2.27
1	WALMEX	*	ALTA	90,250	5,818,417.50	7.55
EMPRESAS DE SALUD						
1	LAB	B	ALTA	124,279	2,561,390.19	3.32
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
CF	FUNO	11	ALTA	70,810	1,691,650.90	2.19
FE	FCFE	18	MEDIA	29,784	821,144.88	1.06
1	BOLSA	A	ALTA	43,392	1,789,920.00	2.32
1	GFINBUR	O	ALTA	100,000	1,857,000.00	2.41
1	GFNORTE	O	ALTA	22,942	2,641,312.46	3.43
1	R	A	ALTA	14,000	1,342,880.00	1.74
EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES						
1	AMX	L	ALTA	258,555	3,609,427.80	4.68
1	MEGA	CPO	ALTA	18,596	1,361,971.04	1.77
1	TLEVISA	CPO	ALTA	20,000	727,600.00	0.94
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					72,248,760.29	93.70
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					72,248,760.29	93.70
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADOR						
LD	BONDESD	230706	mxAAA	48,656	4,859,297.34	6.30
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					4,859,297.34	6.30
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					77,108,057.63	100.00

CATEGORÍA
DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.663%

Límite de VaR
1.720%

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