

GBMfondos

GBMV2 GBM CAPITAL BURSATIL, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 31 DICIEMBRE, 2021

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS ENERGÉTICAS						
1ASP	FEC	N	ALTA	6	997.27	0.00
EMPRESAS MATERIALES						
1	CYDSASA	A	MEDIA	261,690	3,907,031.70	0.21
1	GMEXICO	B	ALTA	2,046,341	182,717,787.89	9.61
1	LAMOS	*	BAJA	9,782	1,105,366.00	0.06
1	MFRISCO	A-1	BAJA	20,920,652	75,314,347.20	3.96
1	VITRO	A	BAJA	51,238	1,237,397.70	0.07
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1	ARA	*	MEDIA	7,871,161	33,767,280.69	1.78
1	DINE	B	MINIMA	3,213,350	62,338,990.00	3.28
1	GISSA	A	MEDIA	19,610	573,592.50	0.03
1	GMD	*	MINIMA	8,003,461	112,048,454.00	5.90
1	KUO	B	MEDIA	9,999,626	453,883,024.14	23.88
1	PASA	B	BAJA	385,000	5,147,450.00	0.27
1	PINFRA	L	BAJA	951,160	94,773,582.40	4.99
1	TMM	A	BAJA	4,998,710	13,846,426.70	0.73
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1	CIDMEGA	*	MINIMA	3,647,917	139,350,429.40	7.33
1	CMR	B	BAJA	6,805,852	11,910,241.00	0.63
1	NEMAK	A	ALTA	659,604	4,010,392.32	0.21
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1	BAFAR	B	MEDIA	2,683,225	182,459,300.00	9.60
1	CULTIBA	B	BAJA	488,884	6,423,935.76	0.34
1	GIGANTE	*	MINIMA	1,808,662	52,270,331.80	2.75
1	MINSA	B	BAJA	9,670,245	77,845,472.25	4.10
EMPRESAS DE SALUD						
1	FRAGUA	B	BAJA	4,795	1,627,662.75	0.09
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
CF	FNOVA	17	MEDIA	60,029	1,529,538.92	0.08
00	POP	N	NULA	4,215,534	4.22	0.00
EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES						
1	AXTEL	CPO	MEDIA	26,903,870	104,117,976.90	5.48
1	QUMMA	B	NULA	9,369,000	9.37	0.00
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					1,622,207,022.88	85.35
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
PAPEL PRIVADO						
91	ADAMFIN	07	HR BBB	1	97.91	0.00
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					97.91	0.00
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					1,622,207,120.79	85.35
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADOR						
IM	BPAG28	240808	mxAAA	105,210	10,480,276.52	0.55
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					10,480,276.52	0.55
OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES						
PRESTAMISTA						
1	GMEXICO	B	ALTA	3,000,000	267,870,000.00	14.09
TOTAL OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES					267,870,000.00	14.09
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					1,900,557,397.31	100.00

CATEGORÍA
DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.109%

Límite de VaR
3.840%

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 período 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