

# GBMfondos

## GBMCRE GBM FONDO DE CRECIMIENTO, S.A. DE C.V. F.I.R.V. CARTERA DE VALORES AL 23 SEPTIEMBRE, 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>						
YYSP	CEMEX	CPO	ALTA	6,576	987,854.94	0.12
1	CEMEX	CPO	ALTA	816,000	12,329,760.00	1.48
1	CYDSASA	A	MEDIA	7,497,511	104,890,178.89	12.61
1	GMEXICO	B	ALTA	256,379	21,405,082.71	2.57
1	POCHTEC	B	BAJA	140,827	1,166,047.56	0.14
<b>EMPRESAS INDUSTRIALES</b>						
1	AGUA	*	MEDIA	89,687	2,581,191.86	0.31
1	ALFA	A	ALTA	294,968	4,191,495.28	0.50
1	GISSA	A	MEDIA	3,721,297	107,545,483.30	12.93
1	GMD	*	MINIMA	3,781,043	46,922,743.63	5.64
1	KUO	B	BAJA	3,937,376	177,181,920.00	21.29
1	PASA	B	BAJA	2,220,388	27,754,850.00	3.34
1	PINFRA	*	ALTA	31,500	4,559,310.00	0.55
1	TMM	A	BAJA	500,000	1,455,000.00	0.17
<b>EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO</b>						
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	48,900	4,389,753.00	0.53
1	NEMAK	A	ALTA	744,315	4,205,379.75	0.51
<b>EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE</b>						
1	BACHOCO	B	MEDIA	142,742	10,922,617.84	1.31
1	BAFAR	B	MEDIA	432,399	19,025,556.00	2.29
1	CULTIBA	B	BAJA	12,077,332	124,517,292.92	14.96
1	FEMSA	UBD	ALTA	63,950	11,397,169.00	1.37
1	MINSA	B	BAJA	3,263,866	28,069,247.60	3.37
<b>EMPRESAS DE SALUD</b>						
1	FRAGUA	B	MEDIA	350,718	113,983,350.00	13.70
<b>EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS</b>						
CF	FNOVA	17	MEDIA	9,971	229,233.29	0.03
<b>TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO</b>					<b>829,710,517.57</b>	<b>99.72</b>
<b>TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>					<b>829,710,517.57</b>	<b>99.72</b>
<b>OPERACIONES DE REPORTO</b>						
<b>REPORTADOR</b>						
BI	CETES	211118	mxAAA	237,392	2,356,533.40	0.28
<b>TOTAL OPERACIONES DE REPORTO</b>					<b>2,356,533.40</b>	<b>0.28</b>
<b>TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES</b>					<b>832,067,050.97</b>	<b>100.00</b>

### CATEGORÍA DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN

VaR Promedio  
0.938%

Límite de VaR  
1.390%

Para llevar a cabo la estimación del Valor en Riesgo (VaR) de mercado para los 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