

# GBMfondos

## GBMMOD GBM FONDO DE INVERSION MODELO, 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>						
1	CEMEX	CPO	ALTA	2,171,899	32,817,393.89	7.23
1	CYDSASA	A	MEDIA	3,889,099	54,408,495.01	11.98
1	GCC	*	ALTA	27,220	4,104,776.00	0.90
1	GMEXICO	B	ALTA	404,500	33,771,705.00	7.44
1	PE&OLES	*	ALTA	21,500	5,445,950.00	1.20
1	VITRO	A	BAJA	394,290	10,641,887.10	2.34
<b>EMPRESAS INDUSTRIALES</b>						
1	AGUA	*	MEDIA	212,770	6,123,520.60	1.35
1	ALFA	A	ALTA	520,000	7,389,200.00	1.63
1	GISSA	A	MEDIA	1,697,931	49,070,205.90	10.81
1	GMXT	*	ALTA	319,976	9,791,265.60	2.16
1	KUO	B	BAJA	1,325,408	59,643,360.00	13.14
1	ORBIA	*	ALTA	80,000	4,027,200.00	0.89
1	PINFRA	*	ALTA	71,000	10,276,540.00	2.26
1	PINFRA	L	BAJA	65,366	6,459,871.36	1.42
<b>EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO</b>						
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	82,614	7,416,258.78	1.63
1	NEMAK	A	ALTA	1,269,319	7,171,652.35	1.58
<b>EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE</b>						
1	BACHOCO	B	MEDIA	91,886	7,031,116.72	1.55
1	CULTIBA	B	BAJA	3,723,340	38,387,635.40	8.45
1	FEMSA	UBD	ALTA	209,000	37,247,980.00	8.20
1	GRUMA	B	ALTA	48,000	11,611,680.00	2.56
1	KIMBER	A	ALTA	135,000	4,588,650.00	1.01
<b>EMPRESAS DE SALUD</b>						
1	FRAGUA	B	MEDIA	43,083	14,001,975.00	3.08
<b>EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES</b>						
1	AMX	L	ALTA	1,150,000	20,930,000.00	4.61
1	TLEVISA	CPO	ALTA	230,000	11,247,000.00	2.48
<b>TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO</b>					<b>453,605,318.71</b>	<b>99.91</b>
<b>TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>					<b>453,605,318.71</b>	<b>99.91</b>
<b>OPERACIONES DE REPORTE</b>						
<b>REPORTADOR</b>						
BI	CETES	211216	mxAAA	43,152	426,455.87	0.09
<b>TOTAL OPERACIONES DE REPORTE</b>					<b>426,455.87</b>	<b>0.09</b>
<b>TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES</b>					<b>454,031,774.58</b>	<b>100.00</b>

### CATEGORÍA ESPECIALIZADA EN ACCIONES

CALIFICACIÓN

VaR Promedio  
0.931%

Límite de VaR  
2.300%

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