

# GBMfondos

## GBMCRE GBM FONDO DE CRECIMIENTO, S.A. DE C.V. F.I.R.V. CARTERA DE VALORES AL 31 AGOSTO, 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	1,082,643.05	0.12
1	CEMEX	CPO	ALTA	116,000	1,914,000.00	0.22
1	CYDSASA	A	BAJA	7,580,171	106,122,394.00	11.96
1	GMEXICO	B	ALTA	256,379	23,984,255.45	2.70
1	POCHTEC	B	BAJA	142,520	1,198,593.20	0.14
<b>EMPRESAS INDUSTRIALES</b>						
1	AGUA	*	MEDIA	92,359	3,080,172.65	0.35
1	ALFA	A	ALTA	509,968	7,190,548.80	0.81
1	GISSA	A	MEDIA	3,837,347	111,244,689.53	12.53
1	GMD	*	MINIMA	3,781,043	49,531,663.30	5.58
1	KUO	B	BAJA	4,503,502	208,512,142.60	23.49
1	PASA	B	MINIMA	2,291,600	27,040,880.00	3.05
1	PINFRA	*	ALTA	31,500	4,725,000.00	0.53
1	TMM	A	BAJA	500,000	1,540,000.00	0.17
<b>EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO</b>						
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	48,900	4,354,545.00	0.49
1	NMK	A	ALTA	2,555,100	7,716,402.00	0.87
<b>EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE</b>						
1	BACHOCO	B	MEDIA	180,242	13,238,774.90	1.49
1	BAFAR	B	BAJA	467,614	18,784,054.38	2.12
1	CULTIBA	B	BAJA	12,218,750	132,084,687.50	14.88
1	FEMSA	UBD	ALTA	85,000	14,863,950.00	1.67
1	MINSA	B	BAJA	3,284,116	29,425,679.36	3.31
<b>EMPRESAS DE SALUD</b>						
1	FRAGUA	B	MEDIA	350,759	115,750,470.00	13.04
<b>TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO</b>					<b>883,385,545.72</b>	<b>99.52</b>
<b>TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>					<b>883,385,545.72</b>	<b>99.52</b>
<b>OPERACIONES DE REPORTO</b>						
<b>REPORTADOR</b>						
BI	CETES	220113	mxAAA	437,421	4,291,572.80	0.48
<b>TOTAL OPERACIONES DE REPORTO</b>					<b>4,291,572.80</b>	<b>0.48</b>
<b>TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES</b>					<b>887,677,118.52</b>	<b>100.00</b>

### CATEGORÍA DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN

VaR Promedio  
0.925%

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