

GBMfondos

GBMCRE GBM FONDO DE CRECIMIENTO, S.A. DE C.V. F.I.R.V. CARTERA DE VALORES AL 29 ABRIL, 2022

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS MATERIALES						
YYSP	CEMEX	CPO	ALTA	6,576	588,679.05	0.08
1	CEMEX	CPO	ALTA	1,859,893	16,701,839.14	2.31
1	CYDSASA	A	MEDIA	8,694,895	117,381,082.50	16.26
1	GMEXICO	B	ALTA	165,290	15,788,500.80	2.19
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1	AGUA	*	MEDIA	67,022	1,638,017.68	0.23
1	GISSA	A	MEDIA	3,291,485	75,704,155.00	10.48
1	GMD	*	BAJA	3,781,043	43,103,890.20	5.97
1	KUO	B	MEDIA	3,813,550	165,851,289.50	22.97
1	PASA	B	MINIMA	2,400,501	31,806,638.25	4.40
1	PINFRA	*	ALTA	9,806	1,458,740.56	0.20
1	TMM	A	BAJA	500,000	1,300,000.00	0.18
1	VINTE	*	BAJA	325,600	9,201,456.00	1.27
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	42,797	4,402,955.36	0.61
1	NEMAK	A	ALTA	604,315	2,677,115.45	0.37
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1	BACHOCO	B	MEDIA	132,742	10,331,309.86	1.43
1	BAFAR	B	BAJA	205,578	11,923,524.00	1.65
1	CULTIBA	B	BAJA	11,493,839	106,547,887.53	14.75
1	FEMSA	UBD	ALTA	117,346	18,005,570.24	2.49
EMPRESAS DE SALUD						
1	FRAGUA	B	MEDIA	245,000	79,135,000.00	10.96
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					713,547,651.12	98.81
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					713,547,651.12	98.81
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADOR						
IM	BPAG28	230209	mxAAA	40,283	4,043,053.95	0.56
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					4,043,053.95	0.56
OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES						
PRESTAMISTA						
1	CULTIBA	B	BAJA	488,884	4,531,954.68	0.63
TOTAL OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES					4,531,954.68	0.63
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					722,122,659.75	100.00

CATEGORÍA
DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
0.914%

Límite de VaR
1.390%

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