GBMfondos

GBMINF GBM INVERSIÓN EN INFRAESTRUCTURA, S.A DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 12 AGOSTO, 2021

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS MATERIALES						
1	CYDSASA	A	BAJA	1,527,337	21,367,444.63	20.79
1	GMEXICO	B	ALTA	78,000	7,215,000.00	7.02
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1	ASUR	B	ALTA	3,600	1,258,524.00	1.22
1	GISSA	A	MEDIA	193,535	5,686,058.30	5.53
1	GMXT	*	ALTA	33,000	1,122,990.00	1.09
1	KUO	B	BAJA	924,502	43,433,103.96	42.25
1	PASA	B	MINIMA	271,100	3,117,650.00	3.03
1	PINFRA	*	ALTA	8,000	1,187,360.00	1.16
1	VINTE	*	MINIMA	449,740	12,907,538.00	12.56
EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES						
1	AMX	L	ALTA	130,000	2,207,400.00	2.15
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					**99,503,068.89**	**96.79**
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					**99,503,068.89**	**96.79**
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADOR						
BI	CETES	220331	mxAAA	44,671	431,790.33	0.42
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					**431,790.33**	**0.42**
OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES						
PRESTAMISTA						
1	PINFRA	*	ALTA	19,300	2,864,506.00	2.79
TOTAL OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES					**2,864,506.00**	**2.79**
TOTAL DE INVERSION EN VALORES					**102,799,365.22**	**100.00**

CATEGORÍA
ESPECIALIZADA EN ACCIONES

CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
	1.009%	1.240%

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