

GBMfondos

GBMCRE GBM FONDO DE CRECIMIENTO, S.A. DE C.V. F.I.R.V. CARTERA DE VALORES AL 22 DICIEMBRE, 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	531,798.03	0.08
1	CEMEX	CPO	ALTA	1,709,893	13,901,430.09	2.02
1	CYDSASA	A	BAJA	6,562,650	98,439,750.00	14.30
1	GMEXICO	B	ALTA	100,578	7,337,165.10	1.07
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1	GISSA	A	MEDIA	2,181,970	69,168,449.00	10.04
1	GMD	*	MINIMA	3,781,043	55,959,436.40	8.13
1	KUO	B	BAJA	3,646,948	161,158,632.12	23.40
1	PASA	B	MINIMA	2,400,501	34,567,214.40	5.02
1	PINFRA	*	ALTA	9,806	1,636,425.28	0.24
1	TMM	A	MINIMA	500,000	1,205,000.00	0.18
1	VINTE	*	BAJA	161,467	5,103,971.87	0.74
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	38,041	4,268,580.61	0.62
1	NEMAK	A	ALTA	489,315	2,896,744.80	0.42
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1	BACHOCO	B	MEDIA	90,000	7,400,700.00	1.07
1	BAFAR	B	BAJA	141,959	8,517,540.00	1.24
1	CULTIBA	B	BAJA	11,249,442	134,880,809.58	19.59
1	FEMSA	UBD	ALTA	60,000	9,141,000.00	1.33
EMPRESAS DE SALUD						
1	FRAGUA	B	MEDIA	223,741	71,597,120.00	10.40
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					687,711,767.28	99.87
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					687,711,767.28	99.87
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADOR						
LF	BONDESF	241128	mxAAA	9,089	911,508.78	0.13
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					911,508.78	0.13
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					688,623,276.06	100.00

	CATEGORÍA	
	DISCRECIONAL	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
	0.866%	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