

GBMfondos

GBMAAA GBM INSTRUMENTOS BURSATILES, S.A. DE C.V. F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 02 MAYO, 2019

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Titulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS MATERIALES						
1	ALPEK	A	ALTA	146,488	3,405,846.00	3.52
1	CEMEX	CPO	ALTA	633,128	5,514,544.88	5.70
1	GCC	*	ALTA	25,433	2,682,418.51	2.77
1	GMEXICO	B	ALTA	131,762	6,993,926.96	7.23
1	MEXICHEM	*	ALTA	108,669	4,743,401.85	4.91
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1	AEROMEX	*	MEDIA	174,736	3,388,131.04	3.50
1	GMXT	*	ALTA	62,262	1,453,917.70	1.50
1	PINFRA	*	ALTA	24,466	4,701,631.22	4.86
1	PINFRA	L	MEDIA	49,668	6,161,686.62	6.37
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1	FOTOLLUZ	B	NULA	100,000	0.10	0.00
1	NEMAK	A	ALTA	236,195	2,446,980.20	2.53
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1	BIMBO	A	ALTA	20,233	861,723.47	0.89
1	CUERVO	*	ALTA	3,051	91,926.63	0.10
1	FEMSA	UBD	ALTA	19,537	3,705,582.79	3.83
1	GRUMA	B	ALTA	5,115	965,456.25	1.00
1	KOF	UBL	MEDIA	50,297	6,128,689.45	6.34
1	LALA	B	ALTA	36,632	915,800.00	0.95
1	SORIANA	B	MEDIA	402,876	9,225,860.40	9.54
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
FE	FCFE	18	MEDIA	72,220	1,363,513.60	1.41
1	GFINBUR	O	ALTA	776	22,372.08	0.02
1	GFNORTE	O	ALTA	60,590	6,920,589.80	7.16
41	BBAJIO	O	ALTA	135,338	5,528,557.30	5.72
EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES						
1	AMX	L	ALTA	498,242	7,020,229.78	7.26
1	TLEVISIA	CPO	ALTA	31,163	1,180,142.81	1.22
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					85,422,829.44	88.35
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
PAPEL PRIVADO						
EAIM	GBM-INT	0003848		665,744	665,744.00	0.69
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					665,744.00	0.69
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					86,088,573.44	89.04
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADO						
LD	BONDESD	230105	mxAAA	13,493	1,342,522.59	1.39
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					1,342,522.59	1.39
OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES						
PRESTAMISTA						
1	AMX	L	ALTA	76,000	1,070,840.00	1.11
1	BIMBO	A	ALTA	10,412	443,447.08	0.46
1	BIMBO	A	ALTA	20,718	882,379.62	0.91
1	BIMBO	A	ALTA	1,464	62,351.76	0.06
1	BIMBO	A	ALTA	8,210	349,663.90	0.36
1	CUERVO	*	ALTA	1,666	50,196.58	0.05
1	CUERVO	*	ALTA	60,444	1,821,177.72	1.88
1	CUERVO	*	ALTA	2,250	67,792.50	0.07
1	CUERVO	*	ALTA	500	15,065.00	0.02
1	FEMSA	UBD	ALTA	320	60,694.40	0.06
1	FEMSA	UBD	ALTA	1,100	208,637.00	0.22
1	GFINBUR	O	ALTA	40,000	1,153,200.00	1.19
1	GFINBUR	O	ALTA	41,848	1,206,477.84	1.25
1	GFNORTE	O	ALTA	1,293	147,686.46	0.15
1	GFNORTE	O	ALTA	452	51,627.44	0.05
1	KOF	UBL	MEDIA	3,010	366,768.50	0.38
1	KOF	UBL	MEDIA	1,000	121,850.00	0.13
1	KOF	UBL	MEDIA	700	85,295.00	0.09
1	LALA	B	ALTA	3,550	88,750.00	0.09
1	LALA	B	ALTA	3,535	88,375.00	0.09
1	LALA	B	ALTA	21	525.00	0.00
1	LALA	B	ALTA	2,300	57,500.00	0.06
1	LALA	B	ALTA	13,400	335,000.00	0.35
1	SORIANA	B	MEDIA	1,189	27,228.10	0.03
1	SORIANA	B	MEDIA	2,500	57,250.00	0.06
1	SORIANA	B	MEDIA	4,500	103,050.00	0.11
1	SORIANA	B	MEDIA	6,309	144,476.10	0.15
1	TLEVISIA	CPO	ALTA	5,000	189,350.00	0.20
TOTAL OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES					9,256,655.00	9.57
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					96,687,751.03	100.00

CLASIFICACIÓN
DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.434%

Limite de VaR
1.860%

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 período 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