GBMfondos

GBMCRE GBM FONDO DE CRECIMIENTO, S.A. DE C.V. F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 02 MAYO, 2019

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA						
BI	CETES	190606	mxAAA	161,621	1,603,714.43	0.07
1	GMEXICO	B	ALTA	132,000	7,006,560.00	0.32
TOTAL DISPONIBILIDADES					**8.610.274.43**	**0.39**
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS MATERIALES						
YYSP	CEMEX	CPO	ALTA	6,576	574,630.41	0.03
1	CEMEX	CPO	ALTA	4,954,541	43,154,052.11	1.98
1	CYDSASA	A	BAJA	10,418,931	284,436,816.30	13.04
1	GMEXICO	B	ALTA	1,333,697	70,792,636.76	3.24
1	MEXCHEM	*	ALTA	317,875	13,875,243.75	0.64
1	POCHTEC	B	BAJA	868,000	5,902,400.00	0.27
1	VITRO	A	MEDIA	1,497,079	79,315,245.42	3.64
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1	AEROMEX	*	MEDIA	1,149,742	22,293,497.38	1.02
1	AGUA	*	MEDIA	3,872,738	72,923,656.54	3.34
1	ALFA	A	ALTA	3,519,416	67,607,981.36	3.10
1	ARA	*	MEDIA	6,717,565	33,386,298.05	1.53
1	GISSA	A	MEDIA	9,821,347	209,194,691.10	9.59
1	GMD	*	MINIMA	3,781,043	73,730,338.50	3.38
1	KUO	B	BAJA	9,044,318	438,558,979.82	20.10
1	PASA	B	MINIMA	2,309,400	43,647,660.00	2.00
1	PINFRA	L	MEDIA	1,169,628	145,101,095.20	6.65
1	TMM	A	BAJA	500,000	3,775,000.00	0.17
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1	HOTEL	*	MEDIA	4,756,141	28,536,846.00	1.31
1	NEMAK	A	ALTA	752,336	7,794,200.96	0.36
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1	BAFAR	B	MINIMA	820,418	33,637,138.00	1.54
1	CULTIBA	B	BAJA	13,147,439	220,876,975.20	10.12
1	MINSA	B	MINIMA	3,353,600	45,240,064.00	2.07
1	SORIANA	B	MEDIA	672,337	15,396,517.30	0.71
EMPRESAS DE SALUD						
1	FRAGUA	B	BAJA	481,875	125,287,500.00	5.74
1	MEDICA	B	BAJA	1,577,708	41,020,408.00	1.88
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					**2,126,059,872.16**	**97.45**
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
BI	CETES	190606	mxAAA	161,751	1,605,004.38	0.07
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					**1.605.004.38**	**0.07**
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					**2.127.664.876.54**	**97.53**
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADO						
M	BONOS	220609	mxAAA	59,440	5,872,840.71	0.27
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					**5,872,840.71**	**0.27**
OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES						
PRESTAMISTA						
1	AEROMEX	*	MEDIA	39,007	756,345.73	0.03
1	AEROMEX	*	MEDIA	3,457	67,031.23	0.00
1	AEROMEX	*	MEDIA	4,200	81,438.00	0.00
1	ALFA	A	ALTA	30,000	576,300.00	0.03
1	ALFA	A	ALTA	120,000	2,305,200.00	0.11
1	ALFA	A	ALTA	75,000	1,440,750.00	0.07
1	CEMEX	CPO	ALTA	80,510	701,242.10	0.03
1	FRAGUA	B	BAJA	3	780.00	0.00
1	GMEXICO	B	ALTA	9,000	477,720.00	0.02
1	GMEXICO	B	ALTA	2,557	135,725.56	0.01
1	GMEXICO	B	ALTA	1,000	53,080.00	0.00
1	GMEXICO	B	ALTA	20,000	1,061,600.00	0.05
1	GMEXICO	B	ALTA	14,410	764,882.80	0.04
1	GMEXICO	B	ALTA	265	14,066.20	0.00
1	GMEXICO	B	ALTA	5,000	265,400.00	0.01
1	GMEXICO	B	ALTA	5,000	265,400.00	0.01
1	GMEXICO	B	ALTA	21,992	1,167,335.36	0.05
1	GMEXICO	B	ALTA	1,000	53,080.00	0.00
1	GMEXICO	B	ALTA	10,000	530,800.00	0.02
1	GMEXICO	B	ALTA	13,500	716,580.00	0.03
1	GMEXICO	B	ALTA	60,000	3,184,800.00	0.15
1	GMEXICO	B	ALTA	17,056	905,332.48	0.04
1	GMEXICO	B	ALTA	340,000	18,047,200.00	0.83
1	GMEXICO	B	ALTA	10,000	530,800.00	0.02
1	GMEXICO	B	ALTA	22,000	1,167,760.00	0.05
1	GMEXICO	B	ALTA	1,000	53,080.00	0.00
1	GMEXICO	B	ALTA	1,172	62,209.76	0.00
1	GMEXICO	B	ALTA	40,000	2,123,200.00	0.10
1	GMEXICO	B	ALTA	2,000	106,160.00	0.00
1	MEXCHEM	*	ALTA	2,787	121,652.55	0.01
1	NEMAK	A	ALTA	220,000	2,279,200.00	0.10
TOTAL OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES					**40.016.151.77**	**1.83**
OPERACIONES CON DERIVADOS						
FUTUROS						
FI	IPC	JN19		5	-22,650.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-4,530.00	0.00
FI	IPC	JN19		4	-18,120.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-4,530.00	0.00
FI	IPC	JN19		4	-18,120.00	0.00
FI	IPC	JN19		3	-13,590.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-4,530.00	0.00
FI	IPC	JN19		4	-18,120.00	0.00
FI	IPC	JN19		5	-22,650.00	0.00
FI	IPC	JN19		3	-13,590.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-4,530.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-4,530.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-4,530.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-4,530.00	0.00
FI	IPC	JN19		2	-9,060.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-4,530.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-4,530.00	0.00
FI	IPC	JN19		2	-9,060.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-4,530.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-4,530.00	0.00
FI	IPC	JN19		2	-9,060.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-4,530.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-4,530.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-4,530.00	0.00
FI	IPC	JN19		5	-22,650.00	0.00
FI	IPC	JN19		5	-22,650.00	0.00
FI	IPC	JN19		5	-22,650.00	0.00
FI	IPC	JN19		5	-22,650.00	0.00
FI	IPC	JN19		5	-22,650.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-4,530.00	0.00
FI	IPC	JN19		3	-13,590.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-4,530.00	0.00
FI	IPC	JN19		5	-22,650.00	0.00
FI	IPC	JN19		5	-22,650.00	0.00
FI	IPC	JN19		4	-18,120.00	0.00
FI	IPC	JN19		2	-9,060.00	0.00
FI	IPC	JN19		3	-13,590.00	0.00
FI	IPC	JN19		2	-9,060.00	0.00
FI	IPC	JN19		3	-13,590.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-4,530.00	0.00
FI	IPC	JN19		4	-18,120.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-4,530.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-4,530.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-4,530.00	0.00
FI	IPC	JN19		2	-9,060.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-4,530.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-4,530.00	0.00
FI	IPC	JN19		3	-13,590.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-4,530.00	0.00
TOTAL OPERACIONES CON DERIVADOS					**-534.540.00**	**-0.02**
TOTAL DE INVERSION EN VALORES					**2.181.629.603.45**	**100.00**

CALIFICACIÓN	CLASIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
	DISCRECIONAL	1.162%	1.290%

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

Lic. Javier Martínez Morodo