

GBMfondos

GBM PICT GBM RETORNO ABSOLUTO, 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
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS MATERIALES						
1ISP	VIS	*	ALTA	8,745	24,284,365.05	1.06
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1ISP	AAXJ	*	ALTA	33,625	46,388,382.54	2.02
1ISP	ASHR	*	NA	164,020	89,915,611.46	3.91
1ISP	BIL	*	ALTA	127,510	222,941,574.84	9.70
1ISP	EMB	*	ALTA	112,920	235,670,493.38	10.25
1ISP	EMLC	*	NA	181,317	113,681,695.69	4.95
1ISP	EXI	*	NA	28,115	49,372,143.54	2.15
1ISP	FLRN	*	NA	473,960	277,949,609.54	12.09
1ISP	GDY	*	ALTA	85,745	33,069,323.02	1.44
1ISP	HEWJ	*	NA	79,705	47,793,872.60	2.08
1ISP	IAU	*	ALTA	200,568	46,672,689.06	2.03
1ISP	IDU	*	ALTA	19,800	55,604,365.15	2.42
1ISP	IEF	*	ALTA	23,315	46,961,216.15	2.04
1ISP	IEI	*	ALTA	112,535	263,248,977.46	11.45
1ISP	IXG	*	NA	39,420	49,521,363.17	2.15
1ISP	KRE	*	NA	21,900	23,378,806.92	1.02
1ISP	PICK	*	NA	39,735	22,922,349.45	1.00
1ISP	QQQ	*	NA	17,210	61,901,811.05	2.69
1ISP	TIP	*	ALTA	108,715	234,024,494.60	10.18
1ISP	VCR	*	ALTA	17,460	59,969,953.32	2.61
1ISP	VGX	*	ALTA	7,963	32,219,849.27	1.40
1ISP	VHT	*	ALTA	16,770	53,893,186.70	2.34
1ISP	VNQ	*	ALTA	40,403	67,157,403.18	2.92
1ISP	XLE	*	ALTA	37,700	45,890,055.82	2.00
1ISP	XLP	*	ALTA	74,490	81,157,941.06	3.53
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					2,285,591,534.02	99.43
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					2,285,591,534.02	99.43
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADO						
LD	BONDESD	200924	mxAAA	64,333	6,412,706.62	0.28
LD	BONDESD	230105	mxAAA	67,264	6,692,613.91	0.29
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					13,105,320.53	0.57
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					2,298,696,854.55	100.00

CLASIFICACIÓN
DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
0.955%

Límite de VaR
5.000%

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