

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Valor Razonable	%
<b>DIRECTO</b>					
<b>ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS</b>					
1	ICH	B	MEDIA	2,633,831,376.00	19.51
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	1,287,266,015.56	9.53
1	LACOMER	UBC	ALTA	1,107,131,197.69	8.20
1	GIGANTE	*	BAJA	1,023,696,719.40	7.58
1	DINE	B	MINIMA	852,201,262.00	6.31
1	SIMEC	B	MEDIA	851,878,241.70	6.31
1	SORIANA	B	BAJA	719,144,092.38	5.33
1	POSADAS	A	BAJA	709,776,512.50	5.26
1	CHDRAUI	B	ALTA	689,866,672.66	5.11
1	PASA	B	MINIMA	538,923,879.00	3.99
1	KUO	B	BAJA	531,928,276.11	3.94
1	KUO	A	BAJA	461,747,132.00	3.42
1				970,480,041.49	7.19
<b>TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)</b>					
1ISP	IB01	N	ALTA	989,728,814.38	7.33
<b>TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO</b>				13,367,600,232.87	99.00
<b>OTROS VALORES</b>				134,915,728.67	1.00
<b>TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES</b>				13,502,515,961.54	100.00

**CATEGORÍA**  
RVDIS

**CALIFICACIÓN**

**VaR Promedio última semana**  
0.699%

**Límite de VaR**  
3.240%

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