

GBMfondos

GBMAGR GBM FONDO DE INVERSION TOTAL, S.A. DE C.V., F.I.R.V. CARTERA DE VALORES AL 30 ABRIL, 2019

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS MATERIALES						
1	CEMEX	CPO	ALTA	6,350,000	55,689,500.00	0.60
1	CYDSASA	A	BAJA	3,413	94,676.62	0.00
1	GMEXICO	B	ALTA	718,750	39,955,312.50	0.43
1	ICH	B	MEDIA	1,147,468	101,470,595.24	1.10
1	MEXCHEM	*	ALTA	1,890,204	83,187,878.04	0.90
1	SIMEC	B	MEDIA	1,168,248	67,781,748.96	0.73
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1	AEROMEX	*	MEDIA	30,773,580	597,930,659.40	6.47
1	AGUA	*	MEDIA	2,643,642	49,594,723.92	0.54
1	ALFA	A	ALTA	5,148,361	98,642,596.76	1.07
1	CERAMIC	B	BAJA	3,087,919	148,220,112.00	1.60
1	DINE	A	BAJA	1,559,771	17,157,481.00	0.19
1	DINE	B	MEDIA	5,933,432	60,521,006.40	0.66
1	GISSA	A	MEDIA	1,159,692	24,631,858.08	0.27
1	GSANBOR	B-1	BAJA	910,634	17,119,919.20	0.19
1	KUO	A	BAJA	2,427,931	111,684,826.00	1.21
1	KUO	B	BAJA	24,683,753	1,196,915,182.97	12.96
1	LAMOSA	*	BAJA	7,879,776	268,148,777.28	2.90
1	PASA	B	MINIMA	30,900	584,010.00	0.01
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1	CIE	B	BAJA	17,527,289	245,907,864.67	2.66
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	1,243,384	152,588,084.48	1.65
1	LIVEPOL	1	BAJA	906,997	113,374,625.00	1.23
1	POSADAS	A	BAJA	24,853,771	907,162,641.50	9.82
1	SPORT	S	BAJA	73,345	1,392,821.55	0.02
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1	BACHOCO	B	ALTA	7,097,646	551,345,141.28	5.97
1	BIMBO	A	ALTA	991,172	41,847,281.84	0.45
1	CHDRAUI	B	MEDIA	5,963,578	223,395,631.88	2.42
1	CUERVO	*	ALTA	1,118,394	33,316,957.26	0.36
1	GIGANTE	*	BAJA	12,697,395	390,571,870.20	4.23
1	HERDEZ	*	MEDIA	9,271,161	376,687,271.43	4.08
1	LACOMER	UBC	MEDIA	27,060,589	585,861,751.85	6.34
1	LALA	B	ALTA	156,805	3,967,166.50	0.04
1	SORIANA	B	MEDIA	19,396,974	445,936,432.26	4.83
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1	GBM	O	BAJA	17,387,846	224,303,213.40	2.43
1	GENEREA	*	ALTA	20,438,634	353,588,368.20	3.83
1	POP	N	NA	27,984,568	27.98	0.00
EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES						
1	AXTEL	CPO	MEDIA	12,009,830	28,103,002.20	0.30
1	RCENTRO	A	MINIMA	745,352	7,363,003.71	0.08
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					7,626,044,021.56	82.56
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
D1SP	UMS19F	2019F	BBB+	71,028	1,434,720,523.93	15.53
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					1,434,720,523.93	15.53
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					9,060,764,545.49	98.09
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADO						
IQ	BPAG91	230831	mxAAA	1,747,542	176,151,650.66	1.91
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					176,151,650.66	1.91
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					9,236,916,196.15	100.00

CLASIFICACIÓN ESPECIALIZADA EN ACCIONES

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
0.772%

Límite de VaR
8.530%

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