

GBMfondos

GBMINF GBM INVERSIÓN EN INFRAESTRUCTURA, 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	ALPEK	A	ALTA	230,738	5,380,810.16	1.32
1	CEMEX	CPO	ALTA	1,658,125	14,541,756.25	3.57
1	CYDSASA	A	BAJA	2,333,714	64,737,226.36	15.90
1	ELEMENT	*	MEDIA	1,104,841	11,479,297.99	2.82
1	GMEXICO	B	ALTA	313,812	17,444,809.08	4.28
1	MEXCHEM	*	ALTA	104,221	4,586,766.21	1.13
1	POCHTEC	B	BAJA	1,821,338	12,749,366.00	3.13
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1	AEROMEX	*	MEDIA	629,624	12,233,594.32	3.00
1	AGUA	*	MEDIA	178,262	3,344,195.12	0.82
1	ALFA	A	ALTA	155,914	2,987,312.24	0.73
1	ARA	*	MEDIA	2,647,353	13,448,553.24	3.30
1	GISSA	A	MEDIA	1,960,571	41,642,528.04	10.22
1	GMXT	*	ALTA	40,538	940,481.60	0.23
1	KUO	B	BAJA	1,854,869	89,942,597.81	22.08
1	PASA	B	MINIMA	273,300	5,165,370.00	1.27
1	PINFRA	L	MEDIA	461,431	57,443,545.19	14.10
1	TRAXION	A	MEDIA	412,005	5,941,112.10	1.46
1	VINTE	*	BAJA	686,377	19,458,787.95	4.78
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1	HOTEL	*	MEDIA	2,229,716	13,467,484.64	3.31
EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES						
1	AMX	L	ALTA	525,000	7,413,000.00	1.82
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					404,348,594.30	99.28
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					404,348,594.30	99.28
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADO						
LD	BONDESD	230309	mxAAA	29,336	2,932,368.81	0.72
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					2,932,368.81	0.72
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					407,280,963.11	100.00

CLASIFICACIÓN ESPECIALIZADA EN ACCIONES

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.126%

Límite de VaR
1.240%

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

Lic. Javier Martínez Morodo