

GBMfondos

GBMMXOP GBM MEXBOL OPTIMIZADO, 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 ENERGÉTICAS						
1	ENOVA	*	ALTA	5,005	414,764.35	0.31
EMPRESAS MATERIALES						
1	ALPEK	A	ALTA	270,836	6,315,895.52	4.64
1	CEMEX	CPO	ALTA	47,725	418,548.25	0.31
1	GCC	*	ALTA	69,672	7,568,469.36	5.57
1	GMEXICO	B	ALTA	50,865	2,827,585.35	2.08
1	MEXCHEM	*	ALTA	9,237	406,520.37	0.30
1	PE&OLES	*	ALTA	1,737	377,919.09	0.28
EMPRESAS INDUSTRIALES						
00	COVAL	A1	NULA	31	0.00	0.00
1	ALFA	A	ALTA	19,847	380,268.52	0.28
1	ASUR	B	ALTA	1,318	411,545.50	0.30
1	GAP	B	ALTA	1,288	248,274.88	0.18
1	GCARSO	A1	ALTA	5,709	419,668.59	0.31
1	OMA	B	ALTA	3,962	462,761.60	0.34
1	PINFRA	*	ALTA	15,401	2,969,928.84	2.18
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BASICO						
1	ALSEA	*	ALTA	9,673	409,941.74	0.30
1	ELEKTRA	*	ALTA	3,549	3,578,882.58	2.63
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	2,776	340,670.72	0.25
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1	AC	*	ALTA	71,072	7,648,057.92	5.62
1	BIMBO	*	ALTA	10,663	450,191.86	0.33
1	CUERVO	*	ALTA	100,665	2,998,810.35	2.21
1	FEMSA	UBD	ALTA	10,820	2,000,942.60	1.47
1	GRUMA	B	ALTA	43,311	8,207,001.39	6.04
1	KIMBER	A	ALTA	13,198	432,498.46	0.32
1	KOF	UBL	ALTA	3,456	417,934.08	0.31
1	WALMEX	*	ALTA	20,807	1,164,728.97	0.86
EMPRESAS DE SALUD						
1	LAB	B	ALTA	14,159	215,783.16	0.16
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1	BOLSA	A	ALTA	162,106	6,336,723.54	4.66
1	GENTERA	O	ALTA	27,520	476,096.00	0.35
1	GFINBUR	O	ALTA	12,156	352,767.12	0.26
1	GFNORTE	O	ALTA	81,490	9,764,946.70	7.18
1	R	A	ALTA	70,031	7,234,902.61	5.32
41	BBAJIO	O	ALTA	211,285	8,611,976.60	6.33
41	BSMX	B	ALTA	15,964	508,293.76	0.37
EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES						
1	AMX	L	ALTA	658,610	9,299,573.20	6.84
1	MEGA	CPO	ALTA	88,811	7,416,606.61	5.45
1	TLEVISIA	CPO	ALTA	9,892	381,435.52	0.28
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					101,470,915.71	74.62
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					101,470,915.71	74.62
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADO						
LD	BONDESD	230309	mxAAA	23,346	2,333,620.20	1.72
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					2,333,620.20	1.72
OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES						
PRESTAMISTA						
1	AC	*	ALTA	5,000	538,050.00	0.40
1	AC	*	ALTA	3,438	369,963.18	0.27
1	AMX	L	ALTA	16,000	225,920.00	0.17
1	AMX	L	ALTA	20,000	282,400.00	0.21
1	AMX	L	ALTA	34,270	483,892.40	0.36
1	AMX	L	ALTA	3,600	50,832.00	0.04
1	ASUR	B	ALTA	30	9,367.50	0.01
1	BOLSA	A	ALTA	30,000	1,172,700.00	0.86
1	CUERVO	*	ALTA	71,353	2,125,606.87	1.56
1	CUERVO	*	ALTA	9,031	269,033.49	0.20
1	CUERVO	*	ALTA	11,196	333,528.84	0.25
1	CUERVO	*	ALTA	8,200	244,278.00	0.18
1	ELEKTRA	*	ALTA	1,777	1,791,962.34	1.32
1	ELEKTRA	*	ALTA	2,229	2,247,768.18	1.65
1	ELEKTRA	*	ALTA	338	340,845.96	0.25
1	ELEKTRA	*	ALTA	720	726,062.40	0.53
1	ELEKTRA	*	ALTA	140	141,178.80	0.10
1	FEMSA	UBD	ALTA	21,716	4,015,939.88	2.95
1	FEMSA	UBD	ALTA	6,500	1,202,045.00	0.88
1	FEMSA	UBD	ALTA	18,000	3,328,740.00	2.45
1	GAP	B	ALTA	1,141	219,939.16	0.16
1	GFINBUR	O	ALTA	2,200	63,844.00	0.05
1	GRUMA	B	ALTA	1,000	189,490.00	0.14
1	ENOVA	*	ALTA	500	41,435.00	0.03
1	LAB	B	ALTA	16,178	246,552.72	0.18
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	784	96,212.48	0.07
1	MEGA	CPO	ALTA	18	1,503.18	0.00
1	MEGA	CPO	ALTA	2,183	182,302.33	0.13
1	MEGA	CPO	ALTA	600	50,106.00	0.04
1	MEGA	CPO	ALTA	1,400	116,914.00	0.09
1	MEGA	CPO	ALTA	574	47,934.74	0.04
1	PINFRA	*	ALTA	4,857	936,623.88	0.69
1	PINFRA	*	ALTA	25,000	4,821,000.00	3.55
1	WALMEX	*	ALTA	9,100	506,961.00	0.37
1	WALMEX	*	ALTA	12,826	714,536.46	0.53
1	WALMEX	*	ALTA	24,342	1,356,092.82	1.00
1	WALMEX	*	ALTA	18,315	1,020,328.65	0.75
1	WALMEX	*	ALTA	25,000	1,392,750.00	1.02
1	WALMEX	*	ALTA	5,000	278,550.00	0.20
TOTAL OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES					32,183,190.26	23.67
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					135,987,726.17	100.00

CLASIFICACIÓN
ESPECIALIZADAS EN ACCIONES INDIZADAS AL IPC

CALIFICACION	VaR Promedio	Límite de VaR
	1.298%	1.750%

Para llevar a cabo la estimación del Valor en Riesgo (VaR) de mercado para los 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