

GBMfondos

GBMPMOD GBM PORTAFOLIO MODERADO, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 30 ABRIL, 2019

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Valor Razonable	%
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					
FONDOS DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA					
51	GBMF2	BF	AAA/2	19,689,974.47	10.21
51	GBMF3	BPV	AA/4	54,215,201.38	28.12
51	GBMPAT	BFF	AAA/5	33,314,661.56	17.28
51	GBMRETO	BFF		16,036,805.88	8.32
FONDOS DE INVERSIÓN DE RENTA VARIABLE					
52	GBMAAA	BFF	NA	3,931,226.05	2.04
52	GBMCRE	BFF	NA	24,615,322.21	12.77
52	GBMDIV2	BO	NA	3,568,328.53	1.85
52	GBMFIBR	BFF	NA	602,960.39	0.31
52	GBMINF	BFF	NA	17,044,509.51	8.84
52	GBMLATM	BO	NA	1,343,132.08	0.70
52	GBMMOD	BFF	NA	11,540,707.83	5.99
52	GBMMOMX	BFF	NA	6,877,009.14	3.57
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO				192,779,839.03	100.00
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR				192,779,839.03	100.00
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES				192,779,839.03	100.00

CLASIFICACIÓN

MAYORITARIAMENTE EN VALORES DE DEUDA A TRAVÉS DE SI

CALIFICACIÓN

VaR Promedio última semana

0.400%

Límite de VaR

0.420%

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

Composición de las Carteras de los Fondos Origen

