

GBMfondos

DYNVAL FONDO SHERPA-HKE DYNAMIC, S.A. de C.V. F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 06 JUNIO, 2019

| Tipo Valor | Emisora | Serie | Calif. / Bursatilidad | Cant. Títulos | Valor Razonable | Participación Porcentual |
|--|---------|--------|-----------------------|---------------|-----------------------|--------------------------|
| TÍTULOS PARA NEGOCIAR | | | | | | |
| INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO | | | | | | |
| EMPRESAS INDUSTRIALES | | | | | | |
| 1 | PINFRA | L | MEDIA | 120,628 | 14,354,732.00 | 2.22 |
| EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO | | | | | | |
| 1 | ALSEA | * | ALTA | 348,500 | 12,455,390.00 | 1.92 |
| 1 | HOTEL | * | MEDIA | 2,102,777 | 12,196,106.60 | 1.88 |
| EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE | | | | | | |
| 1ASP | ARYN | N | NA | 1,734,920 | 40,228,143.48 | 6.21 |
| EMPRESAS DE SALUD | | | | | | |
| 1ASP | CVS | * | ALTA | 45,277 | 48,131,001.19 | 7.43 |
| 1ASP | MYL | N | NA | 61,440 | 21,062,812.26 | 3.25 |
| EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS | | | | | | |
| FH | FHIPO | 14 | MEDIA | 740,824 | 12,356,944.32 | 1.91 |
| 0 | CREAL | * | MEDIA | 1,873,574 | 45,621,526.90 | 7.05 |
| 1ASP | AXP | * | ALTA | 13,906 | 32,627,618.51 | 5.04 |
| 1ASP | FIHU | N | NA | 154,426 | 41,259,983.43 | 6.37 |
| 1ASP | GS | * | ALTA | 3,274 | 12,208,645.48 | 1.89 |
| 1ASP | HHC | * | NA | 19,170 | 38,640,184.56 | 5.97 |
| 1ASP | KKRC | * | NA | 97,953 | 45,780,644.48 | 7.07 |
| 1E | C | * | MEDIA | 12,452 | 16,224,956.00 | 2.51 |
| 1ISP | FXI | * | ALTA | 19,987 | 15,765,323.27 | 2.43 |
| 1ISP | SHV | * | ALTA | 44,964 | 97,592,922.43 | 15.07 |
| EMPRESAS DE TECNOLOGÍA DE LA INFORMACIÓN | | | | | | |
| 1ASP | ASML | N | NA | 6,924 | 26,051,959.81 | 4.02 |
| 1ASP | SSNC | * | NA | 8,576 | 9,716,378.90 | 1.50 |
| EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES | | | | | | |
| 1ASP | CTL | * | NA | 328,910 | 67,718,616.82 | 10.46 |
| EMPRESAS DE SERVICIOS PÚBLICOS | | | | | | |
| 1ASP | FFH | N | ALTA | 3,621 | 33,703,954.81 | 5.21 |
| TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO | | | | | 643,697,845.25 | 99.41 |
| TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR | | | | | 643,697,845.25 | 99.41 |
| OPERACIONES DE REPORTO | | | | | | |
| REPORTADO | | | | | | |
| M | BONOS | 241205 | mxAAA | 33,468 | 3,835,911.19 | 0.59 |
| TOTAL OPERACIONES DE REPORTO | | | | | 3,835,911.19 | 0.59 |
| TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES | | | | | 647,533,756.44 | 100.00 |

CLASIFICACIÓN
DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.689%

Límite de VaR
3.720%

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