

gbmfondos

GBMAAA GBM INSTRUMENTOS BURSATILES, 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 MATERIALES						
1	ALPEK	A	ALTA	146,488	3,269,612.16	3.56
1	CEMEX	CPO	ALTA	633,128	5,077,686.56	5.53
1	GCC	*	ALTA	25,433	2,674,279.95	2.91
1	GMEXICO	B	ALTA	131,762	6,630,263.84	7.22
1	MEXCHEM	*	ALTA	108,669	4,430,435.13	4.83
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1	AEROMEX	*	MEDIA	174,736	3,183,689.92	3.47
1	GMXT	*	ALTA	62,178	1,497,246.24	1.63
1	PINFRA	*	ALTA	5,166	981,901.62	1.07
1	PINFRA	L	MEDIA	43,168	5,136,932.00	5.60
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1	FOTOLLUZ	B	NULA	100,000	0.10	0.00
1	NEMAK	A	ALTA	236,195	1,934,437.05	2.11
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1	BIMBO	A	ALTA	42,415	1,702,538.10	1.86
1	CUERVO	*	ALTA	5,217	153,014.61	0.17
1	FEMSA	UBD	ALTA	7,141	1,349,291.95	1.47
1	GRUMA	B	ALTA	5,115	965,558.55	1.05
1	KOF	UBL	ALTA	51,997	6,491,305.48	7.07
1	LALA	B	ALTA	37,414	894,942.88	0.98
1	SORIANA	B	MEDIA	382,644	8,785,506.24	9.57
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
FE	FCFE	18	MEDIA	72,220	1,321,626.00	1.44
1	GFINBUR	O	ALTA	42,624	1,125,273.60	1.23
1	GFNORTE	O	ALTA	62,335	6,451,049.15	7.03
41	BBAJIO	O	ALTA	135,338	5,144,197.38	5.61
EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES						
1	AMX	L	ALTA	677,242	9,671,015.76	10.54
1	TLEVISIA	CPO	ALTA	6,163	230,188.05	0.25
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					79,102,052.32	86.19
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
PAPEL PRIVADO						
EAIM	GBM-HINT	0003848		684,063	684,063.00	0.75
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					684,063.00	0.75
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					79,786,115.32	86.94
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADO						
IQ	BPAG91	220825	mxAAA	6,644	662,992.56	0.72
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					662,992.56	0.72
OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES						
PRESTAMISTA						
1	BIMBO	A	ALTA	8,210	329,549.40	0.36
1	BIMBO	A	ALTA	10,412	417,937.68	0.46
1	CUERVO	*	ALTA	2,250	65,992.50	0.07
1	CUERVO	*	ALTA	60,444	1,772,822.52	1.93
1	FEMSA	UBD	ALTA	800	151,160.00	0.16
1	FEMSA	UBD	ALTA	500	94,475.00	0.10
1	FEMSA	UBD	ALTA	1,150	217,292.50	0.24
1	FEMSA	UBD	ALTA	500	94,475.00	0.10
1	FEMSA	UBD	ALTA	1,000	188,950.00	0.21
1	FEMSA	UBD	ALTA	925	174,778.75	0.19
1	FEMSA	UBD	ALTA	780	147,381.00	0.16
1	FEMSA	UBD	ALTA	320	60,464.00	0.07
1	FEMSA	UBD	ALTA	341	64,431.95	0.07
1	GFINBUR	O	ALTA	40,000	1,056,000.00	1.15
1	GMXT	*	ALTA	84	2,022.72	0.00
1	KOF	UBL	ALTA	3,010	375,768.40	0.41
1	LALA	B	ALTA	1,500	35,880.00	0.04
1	LALA	B	ALTA	250	5,380.00	0.01
1	LALA	B	ALTA	5,830	139,453.60	0.15
1	LALA	B	ALTA	3,550	84,916.00	0.09
1	LALA	B	ALTA	10,894	260,584.48	0.28
1	PINFRA	*	ALTA	19,300	3,668,351.00	4.00
1	SORIANA	B	MEDIA	650	14,924.00	0.02
1	SORIANA	B	MEDIA	10,430	239,472.80	0.26
1	SORIANA	B	MEDIA	2,843	65,275.28	0.07
1	SORIANA	B	MEDIA	6,989	160,467.44	0.17
1	SORIANA	B	MEDIA	10,500	241,080.00	0.26
1	SORIANA	B	MEDIA	2,172	49,869.12	0.05
1	SORIANA	B	MEDIA	1,146	26,312.16	0.03
1	TLEVISIA	CPO	ALTA	16,000	537,600.00	0.65
1	TLEVISIA	CPO	ALTA	7,000	261,450.00	0.28
1	TLEVISIA	CPO	ALTA	7,000	261,450.00	0.28
TOTAL OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES					11,326,567.30	12.34
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					91,775,675.18	100.00

CLASIFICACIÓN DISCRECIONAL

CALIFICACION

VaR Promedio
1.368%

Limite de VaR
1.860%

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