GBMfondos

GBMCRE GBM FONDO DE CRECIMIENTO, S.A. DE C.V. F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 13 JUNIO, 2019

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA						
BI	CETES	190704	mxAAA	322,216	3,207,459.22	0.16
1	GMEXICO	B	ALTA	202,000	10,602,980.00	0.52
TOTAL DISPONIBILIDADES					**13,810,439.22**	**0.68**
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS MATERIALES						
YYSP	CEMEX	CPO	ALTA	6,576	531,379.11	0.03
1	CEMEX	CPO	ALTA	4,540,541	36,415,138.82	1.79
1	CYDSASA	A	BAJA	10,418,931	282,248,840.79	13.91
1	GMEXICO	B	ALTA	1,665,328	87,413,066.72	4.31
1	MEXCHEM	*	ALTA	284,662	11,708,148.06	0.58
1	POCHTEC	B	BAJA	868,000	6,327,720.00	0.31
1	VITRO	A	MEDIA	1,497,079	75,303,073.70	3.71
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1	AEROMEX	*	MEDIA	1,164,573	21,160,291.41	1.04
1	AGUA	*	MEDIA	3,795,104	63,150,530.56	3.11
1	ALFA	A	ALTA	3,155,416	58,343,641.84	2.88
1	ARA	*	MEDIA	6,509,901	27,927,475.29	1.38
1	GISSA	A	MEDIA	9,054,016	188,232,992.64	9.28
1	GMD	*	MINIMA	3,781,043	71,839,817.00	3.54
1	KUO	B	BAJA	8,999,218	431,872,471.82	21.28
1	PASA	B	MINIMA	2,309,400	43,647,660.00	2.15
1	PINFRA	L	MEDIA	938,484	111,688,980.84	5.50
1	TMM	A	BAJA	500,000	3,685,000.00	0.18
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1	HOTEL	*	MEDIA	4,756,141	27,585,617.80	1.36
1	NEMAK	A	ALTA	752,336	6,515,229.76	0.32
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1	BAFAR	B	MINIMA	820,989	33,660,549.00	1.66
1	CULTIBA	B	BAJA	13,147,439	198,526,328.90	9.78
1	MINSA	B	MINIMA	3,353,600	44,904,704.00	2.21
1	SORIANA	B	MEDIA	672,337	15,725,962.43	0.77
EMPRESAS DE SALUD						
1	FRAGUA	B	BAJA	481,875	122,261,325.00	6.02
1	MEDICA	B	BAJA	1,577,708	38,653,846.00	1.90
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					**2,009,329,791.49**	**99.02**
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
BI	CETES	190704	mxAAA	27,784	276,572.38	0.01
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					**276,572.38**	**0.01**
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					**2,009,606,363.87**	**99.03**
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADO						
IM	BPAG28	200220	mxAAA	22,529	2,250,946.96	0.11
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					**2,250,946.96**	**0.11**
OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES						
PRESTAMISTA						
1	AEROMEX	*	MEDIA	3,457	62,813.69	0.00
1	CEMEX	CPO	ALTA	80,510	645,690.20	0.03
1	FRAGUA	B	BAJA	3	761.16	0.00
1	GMEXICO	B	ALTA	6,000	314,940.00	0.02
1	GMEXICO	B	ALTA	10,000	524,900.00	0.03
1	GMEXICO	B	ALTA	1,000	52,490.00	0.00
1	GMEXICO	B	ALTA	265	13,909.85	0.00
1	GMEXICO	B	ALTA	17,056	895,269.44	0.04
1	NEMAK	A	ALTA	220,000	1,905,200.00	0.09
TOTAL OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES					**4,415,974.34**	**0.22**
OPERACIONES CON DERIVADOS						
FUTUROS						
FI	IPC	JN19		3	-9,930.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-3,310.00	0.00
FI	IPC	JN19		4	-13,240.00	0.00
FI	IPC	JN19		5	-16,550.00	0.00
FI	IPC	JN19		3	-9,930.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-3,310.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-3,310.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-3,310.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-3,310.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-3,310.00	0.00
FI	IPC	JN19		2	-6,620.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-3,310.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-3,310.00	0.00
FI	IPC	JN19		2	-6,620.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-3,310.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-3,310.00	0.00
FI	IPC	JN19		2	-6,620.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-3,310.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-3,310.00	0.00
FI	IPC	JN19		5	-16,550.00	0.00
FI	IPC	JN19		5	-16,550.00	0.00
FI	IPC	JN19		2	-6,620.00	0.00
FI	IPC	JN19		3	-9,930.00	0.00
FI	IPC	JN19		5	-16,550.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-3,310.00	0.00
FI	IPC	JN19		4	-13,240.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-3,310.00	0.00
FI	IPC	JN19		4	-13,240.00	0.00
FI	IPC	JN19		5	-16,550.00	0.00
FI	IPC	JN19		5	-16,550.00	0.00
FI	IPC	JN19		5	-16,550.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-3,310.00	0.00
FI	IPC	JN19		3	-9,930.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-3,310.00	0.00
FI	IPC	JN19		5	-16,550.00	0.00
FI	IPC	JN19		5	-16,550.00	0.00
FI	IPC	JN19		2	-6,620.00	0.00
FI	IPC	JN19		3	-9,930.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-3,310.00	0.00
FI	IPC	JN19		4	-13,240.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-3,310.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-3,310.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-3,310.00	0.00
FI	IPC	JN19		2	-6,620.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-3,310.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-3,310.00	0.00
FI	IPC	JN19		3	-9,930.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-3,310.00	0.00
FI	IPC	JN19		4	-13,240.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-3,310.00	0.00
FI	IPC	JN19		4	-13,240.00	0.00
FI	IPC	JN19		3	-9,930.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-3,310.00	0.00
FI	IPC	JN19		4	-13,240.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-3,310.00	0.00
FI	IPC	JN19		4	-13,240.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-3,310.00	0.00
FI	IPC	JN19		3	-9,930.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-3,310.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-3,310.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-3,310.00	0.00
FI	IPC	JN19		2	-6,620.00	0.00
FI	IPC	JN19		2	-6,620.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-3,310.00	0.00
FI	IPC	JN19		2	-6,620.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-3,310.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-3,310.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-3,310.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-3,310.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-3,310.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-3,310.00	0.00
FI	IPC	JN19		5	-16,550.00	0.00
FI	IPC	JN19		2	-6,620.00	0.00
FI	IPC	JN19		3	-9,930.00	0.00
FI	IPC	JN19		3	-9,930.00	0.00
FI	IPC	JN19		2	-6,620.00	0.00
FI	IPC	JN19		2	-6,620.00	0.00
FI	IPC	JN19		3	-9,930.00	0.00
FI	IPC	JN19		2	-6,620.00	0.00
FI	IPC	JN19		3	-9,930.00	0.00
FI	IPC	JN19		2	-6,620.00	0.00
FI	IPC	JN19		2	-6,620.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-3,310.00	0.00
FI	IPC	JN19		4	-13,240.00	0.00
FI	IPC	JN19		5	-16,550.00	0.00
FI	IPC	JN19		5	-16,550.00	0.00
FI	IPC	JN19		5	-16,550.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-3,310.00	0.00
FI	IPC	JN19		4	-13,240.00	0.00
FI	IPC	JN19		5	-16,550.00	0.00
FI	IPC	JN19		1	-3,310.00	0.00
FI	IPC	JN19		3	-9,930.00	0.00
FI	IPC	JN19		5	-16,550.00	0.00
TOTAL OPERACIONES CON DERIVADOS					**-781,160.00**	**-0.04**
TOTAL DE INVERSION EN VALORES					**2,029,302,564.39**	**100.00**

CALIFICACIÓN	CLASIFICACIÓN	Límite de VaR
	DISCRECIONAL	
	VaR Promedio	
	1.106%	1.290%

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