

# GBMfondos

## GBMINF GBM INVERSIÓN EN INFRAESTRUCTURA, 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
<b>TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>						
<b>INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO</b>						
<b>EMPRESAS MATERIALES</b>						
1	ALPEK	A	ALTA	230,738	5,221,600.94	1.40
1	CEMEX	CPO	ALTA	1,658,125	13,298,162.50	3.56
1	CYDSASA	A	BAJA	2,333,714	63,220,312.26	16.92
1	ELEMENT	*	MEDIA	1,104,841	10,484,941.09	2.81
1	GMEXICO	B	ALTA	313,812	16,471,991.88	4.41
1	MEXCHEM	*	ALTA	104,221	4,286,609.73	1.15
1	POCHTEC	B	BAJA	1,821,338	13,277,554.02	3.55
<b>EMPRESAS INDUSTRIALES</b>						
1	AEROMEX	*	MEDIA	629,624	11,440,268.08	3.06
1	AGUA	*	MEDIA	178,262	2,966,279.68	0.79
1	ALFA	A	ALTA	155,914	2,882,849.86	0.77
1	ARA	*	MEDIA	2,597,353	11,142,644.37	2.98
1	GISSA	A	MEDIA	1,807,079	37,569,172.41	10.05
1	GMXT	*	ALTA	40,538	938,860.08	0.25
1	KUO	B	BAJA	1,845,020	88,542,509.80	23.69
1	PASA	B	MINIMA	273,300	5,165,370.00	1.38
1	PINFRA	L	MEDIA	335,931	39,979,148.31	10.70
1	TRAXION	A	MEDIA	412,005	5,941,112.10	1.59
1	VINTE	*	MEDIA	673,349	18,705,635.22	5.01
<b>EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO</b>						
1	HOTEL	*	MEDIA	2,229,716	12,932,352.80	3.46
<b>EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES</b>						
1	AMX	L	ALTA	525,000	7,444,500.00	1.99
<b>TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO</b>					<b>371,911,875.13</b>	<b>99.53</b>
<b>OPERACIONES DE REPORTE</b>					<b>371,911,875.13</b>	<b>99.53</b>
<b>REPORTADO</b>						
IM	BPAG28	200220	mxAAA	17,730	1,771,462.99	0.47
<b>TOTAL OPERACIONES DE REPORTE</b>					<b>1,771,462.99</b>	<b>0.47</b>
<b>TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES</b>					<b>373,683,338.12</b>	<b>100.00</b>

### CLASIFICACIÓN ESPECIALIZADA EN ACCIONES

CALIFICACIÓN

VaR Promedio  
1.062%

Límite de VaR  
1.240%

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