

GBMfondos

GBMMOD GBM FONDO DE INVERSION MODELO, 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	CEMEX	CPO	ALTA	4,337,002	34,782,756.04	3.09
1	CYDSASA	A	BAJA	5,042,537	137,661,260.10	12.23
1	GCC	*	ALTA	66,706	7,014,135.90	0.62
1	GMEXICO	B	ALTA	2,120,499	106,703,509.68	9.48
1	MEXCHEM	*	ALTA	1,238,599	50,497,681.23	4.49
1	VITRO	A	MEDIA	720,525	36,667,517.25	3.26
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1	AEROMEX	*	MEDIA	890,862	16,231,505.64	1.44
1	AGUA	*	MEDIA	3,543,541	60,559,115.69	5.38
1	ALFA	A	ALTA	3,045,190	53,169,017.40	4.72
1	ARA	*	MEDIA	9,518,471	41,310,164.14	3.67
1	GISSA	A	MEDIA	3,111,661	65,033,714.90	5.78
1	GMXT	*	ALTA	3,930,056	94,635,748.48	8.41
1	KUO	B	BAJA	2,315,346	112,016,439.48	9.95
1	PINFRA	L	MEDIA	935,640	111,341,160.00	9.89
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1	BACHOCO	B	ALTA	131,425	11,047,585.50	0.98
1	CULTIBA	B	BAJA	4,176,726	66,952,917.78	5.95
1	GRUMA	B	ALTA	64,015	12,084,111.55	1.07
EMPRESAS DE SALUD						
1	FRAGUA	B	BAJA	65,027	16,916,774.05	1.50
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1	R	A	ALTA	118,167	11,069,884.56	0.98
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					1,045,694,999.37	92.92
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					1,045,694,999.37	92.92
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADO						
S	UDIBONO	201210	mxAAA	4,079	2,549,276.51	0.23
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					2,549,276.51	0.23
OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES						
PRESTAMISTA						
1	ALFA	A	ALTA	43,000	750,780.00	0.07
1	ALFA	A	ALTA	120,000	2,095,200.00	0.19
1	ALFA	A	ALTA	20,000	349,200.00	0.03
1	ALFA	A	ALTA	500	8,730.00	0.00
1	CEMEX	CPO	ALTA	21,823	175,020.46	0.02
1	CEMEX	CPO	ALTA	3,000	24,060.00	0.00
1	CEMEX	CPO	ALTA	3,400	27,268.00	0.00
1	CEMEX	CPO	ALTA	7,000	56,140.00	0.01
1	GCC	*	ALTA	10,526	1,106,808.90	0.10
1	GCC	*	ALTA	30,314	3,187,517.10	0.28
1	GMEXICO	B	ALTA	5,000	251,600.00	0.02
1	GMEXICO	B	ALTA	10,000	503,200.00	0.04
1	GMXT	*	ALTA	850	20,468.00	0.00
1	GMXT	*	ALTA	15,428	371,506.24	0.03
1	GRUMA	B	ALTA	10,000	1,887,700.00	0.17
1	GRUMA	B	ALTA	21,000	3,964,170.00	0.35
1	GRUMA	B	ALTA	24,000	4,530,480.00	0.40
1	GRUMA	B	ALTA	15,000	2,831,550.00	0.25
1	GRUMA	B	ALTA	20,200	3,813,154.00	0.34
1	GRUMA	B	ALTA	109,383	20,648,228.91	1.83
1	GRUMA	B	ALTA	1,254	236,717.58	0.02
1	GRUMA	B	ALTA	49,000	9,249,730.00	0.82
1	GRUMA	B	ALTA	40,693	7,681,617.61	0.68
1	GRUMA	B	ALTA	500	94,385.00	0.01
1	GRUMA	B	ALTA	70,559	13,319,422.43	1.18
TOTAL OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES					77,184,654.23	6.86
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					1,125,428,930.11	100.00

CLASIFICACIÓN ESPECIALIZADA EN ACCIONES

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.317%

Límite de VaR
1.510%

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