

gbmfondos

GBMPAGR GBM PORTAFOLIO AGRESIVO, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 06 JUNIO, 2019

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Valor Razonable	%
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					
FONDOS DE INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA					
51	GBMF2	BF	AAA/2	2,510,188.57	4.74
51	GBMF3	BPV	AA/4	10,437,972.98	19.69
51	GBMPAT	BFF	AAA/5	6,433,125.19	12.14
51	GBMRETO	BFF	AAA/5	3,088,749.10	5.83
FONDOS DE INVERSIÓN DE RENTA VARIABLE					
52	GBMAAA	BFF	NA	2,210,814.75	4.17
52	GBMCRE	BFF	NA	9,844,363.49	18.57
52	GBMDIV2	BO	NA	1,046,133.93	1.97
52	GBMFIBR	BFF	NA	226,821.79	0.43
52	GBMINF	BFF	NA	6,204,532.19	11.71
52	GBMLATM	BO	NA	724,844.08	1.37
52	GBMMOD	BFF	NA	8,557,298.33	16.15
52	GBMMOMX	BFF	NA	1,716,594.48	3.24
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO				53,001,438.88	100.00
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR				53,001,438.88	100.00
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES				53,001,438.88	100.00

CLASIFICACIÓN

MAYORITARIAMENTE EN ACCIONES A TRAVÉS DE S.I.

CALIFICACIÓN

VaR Promedio última semana
0.646%

Límite de VaR
0.740%

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

Composición de las Carteras de los Fondos Origen

