

GBMfondos

GBM PICT GBM RETORNO ABSOLUTO, 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 DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1ISP	ASHR	*	NA	46,080	23,609,662.34	0.98
1ISP	BIL	*	ALTA	173,195	311,299,695.74	12.95
1ISP	EMB	*	ALTA	112,920	245,843,502.02	10.23
1ISP	EMLC	*	NA	72,500	47,201,981.37	1.96
1ISP	FLRN	*	NA	473,960	285,298,948.00	11.87
1ISP	GDX	*	ALTA	85,745	38,525,181.00	1.60
1ISP	IAU	*	ALTA	200,568	50,278,468.07	2.09
1ISP	IDU	*	ALTA	19,800	59,476,087.84	2.47
1ISP	IEF	*	ALTA	86,595	185,093,611.95	7.70
1ISP	IEI	*	ALTA	140,500	344,642,929.61	14.34
1ISP	IWQU	N	NA	103,220	73,306,397.06	3.05
1ISP	PICK	*	NA	39,735	22,349,786.81	0.93
1ISP	QQQ	*	NA	17,210	60,050,690.16	2.50
1ISP	TIP	*	ALTA	128,130	288,749,887.97	12.01
1ISP	VCR	*	ALTA	13,705	46,229,484.80	1.92
1ISP	VGT	*	ALTA	11,518	45,713,151.14	1.90
1ISP	VHT	*	ALTA	7,085	23,413,232.83	0.97
1ISP	VNQ	*	ALTA	40,403	70,397,621.64	2.93
1ISP	VWO	*	ALTA	28,715	22,892,360.79	0.95
1ISP	XLP	*	ALTA	74,490	84,980,546.33	3.54
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					2,329,353,227.47	96.90
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					2,329,353,227.47	96.90
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADO						
IQ	BPAG91	220825	mxAAA	745,723	74,414,329.59	3.10
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					74,414,329.59	3.10
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					2,403,767,557.06	100.00

CLASIFICACION
DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
0.961%

Límite de VaR
5.000%

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