



**GBMTRV GBM INVERSIONES EN INDICES INTERNACIONALES DE RENTA VARIABLE, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 04 OCTUBRE, 2018**

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA						
1ISP	SHY	*	ALTA	1,000	1,584,799.30	0.27
TOTAL DISPONIBILIDADES					1,584,799.30	0.27
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1ISP	MTUM	*	NA	16,300	36,638,762.82	6.19
1ISP	QQQ	*	NA	14,000	48,811,818.44	8.25
1ISP	VB	*	ALTA	19,850	60,142,588.60	10.17
1ISP	VGK	*	ALTA	65,700	69,543,994.65	11.76
1ISP	VIG	*	NA	24,600	51,692,979.74	8.74
1ISP	VIGI	*	NA	42,150	50,272,710.90	8.50
1ISP	VOO	*	NA	16,400	83,408,541.55	14.10
1ISP	VPL	*	ALTA	53,000	70,123,641.21	11.85
1ISP	VSS	*	ALTA	25,500	53,476,939.95	9.04
1ISP	VWO	*	ALTA	80,700	60,784,030.86	10.27
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					584,896,008.72	98.87
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
PAPEL PRIVADO						
EAIM	GBM-INT	0009126		168,015	168,015.00	0.03
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					168,015.00	0.03
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					585,064,023.72	98.89
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADO						
LD	BONDESD	200924	mxAAA	49,697	4,959,625.61	0.84
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					4,959,625.61	0.84
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					591,608,448.63	100.00

CLASIFICACIÓN

ESPECIALIZADA EN ACCIONES A TRAVÉS DE TRACKERS INTERNACIONALES

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.227%

Límite de VaR
5.330%

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