



GBMTRV GBM INVERSIONES EN INDICES INTERNACIONALES DE RENTA VARIABLE, S.A. DE C.V., S.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 10 mayo, 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	1,597,669.92	0.28
TOTAL DISPONIBILIDADES					1,597,669.92	0.28
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1ISP	MTUM	*	NA	18,750	39,992,179.50	7.05
1ISP	QQQ	*	NA	12,600	41,060,116.94	7.23
1ISP	VB	*	ALTA	17,000	49,970,412.00	8.80
1ISP	VGK	*	ALTA	25,660	29,647,812.39	5.22
1ISP	VIG	*	NA	25,950	50,573,054.02	8.91
1ISP	VIGI	*	NA	34,900	44,655,220.08	7.87
1ISP	VOO	*	NA	23,500	112,807,292.52	19.87
1ISP	VPL	*	ALTA	49,400	70,022,591.18	12.34
1ISP	VSS	*	ALTA	19,500	45,390,655.44	8.00
1ISP	VWO	*	ALTA	62,000	55,114,232.88	9.71
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					539,233,566.95	95.00
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
PAPEL PRIVADO						
EAIM	GBM-INT	0009126		159,683	159,683.00	0.03
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					159,683.00	0.03
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					539,393,249.95	95.02
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADO						
LD	BONDESD	200528	mxAAA	8,390	837,208.84	0.15
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					837,208.84	0.15
OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES						
PRESTAMISTA						
1ISP	VGK	*	ALTA	22,340	25,811,852.25	4.55
TOTAL OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES					25,811,852.25	4.55
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					567,639,980.96	100.00

CLASIFICACIÓN

ESPECIALIZADA EN ACCIONES A TRAVÉS DE TRACKERS INTERNACIONALES

CALIFICACIÓN

VaR Promedio

1.100%

Límite de VaR

5.330%

Para llevar a cabo la estimación del Valor en Riesgo (VaR) de mercado para las Sociedades de Inversión administradas 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 Modoro