



GBM101 GBM 101, S.A. DE C.V., S.I.R.V
CARTERA DE VALORES AL 06 octubre, 2016

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS ENERGÉTICAS						
1	IENOVA	*	ALTB	4,850	377,912.00	0.50
EMPRESAS MATERIALES						
1	ALPEK	A	ALTB	187,606	6,279,172.82	8.38
1	CEMEX	CPO	ALTB	86,161	1,354,450.92	1.81
1	GMEXICO	B	ALTB	17,070	814,751.10	1.09
1	PE&OLES	*	ALTB	12,935	5,633,580.55	7.52
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1	ASUR	B	ALTB	18,881	5,541,384.69	7.39
1	GAP	B	ALTB	39,934	7,487,225.66	9.99
1	OMA	B	ALTB	45,659	5,382,739.51	7.18
1	VOLAR	A	ALTB	87,114	3,012,402.12	4.02
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1	ALSEA	*	ALTB	111,772	7,517,784.72	10.03
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1	AC	*	ALTB	10,834	1,297,154.82	1.73
1	BIMBO	A	ALTB	17,263	906,134.87	1.21
1	GRUMA	B	ALTB	22,495	5,767,493.05	7.69
1	KOF	L	ALTB	19,688	2,949,853.04	3.94
1	WALMEX	*	ALTB	17,268	734,926.08	0.98
EMPRESAS DE SALUD						
1	LAB	B	ALTB	300,911	6,225,848.59	8.31
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1	BOLSA	A	ALTB	40,463	1,252,734.48	1.67
1	GENTERA	*	ALTB	58,988	2,150,702.48	2.87
1	GFNORTE	O	ALTB	2,892	307,564.20	0.41
1	GFREGIO	O	ALTB	3,973	446,247.36	0.60
1	SANMEX	B	ALTB	79,917	2,799,492.51	3.73
1B	NAFTRAC	ISHRS	ALTB	7,841	375,427.08	0.50
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					68,614,982.65	91.54
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					68,614,982.65	91.54
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADO						
BI	CETES	170330	mxA-1+	649,603	6,343,686.80	8.46
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					6,343,686.80	8.46
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					74,958,669.45	100.00

**CLASIFICACIÓN
DISCRECIONAL**

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.132%

Límite de VaR
3.410%

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. Gerardo Diez García