

gbmfondos

GBMCRE GBM FONDO DE CRECIMIENTO, S.A. DE C.V. F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 31 OCTUBRE, 2019

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS MATERIALES						
YYSP	CEMEX	CPO	ALTA	6,576	476,926.87	0.03
1	CEMEX	CPO	ALTA	4,753,051	34,364,558.73	2.13
1	CYDSASA	A	BAJA	9,846,156	256,000,056.00	15.88
1	GMEXICO	B	ALTA	1,605,377	81,344,452.59	5.05
1	POCHTEC	B	BAJA	868,000	6,023,920.00	0.37
1	VITRO	A	MEDIA	376,066	15,964,001.70	0.99
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1	AEROMEX	*	MEDIA	359,286	5,353,361.40	0.33
1	AGUA	*	MEDIA	2,330,276	40,896,343.80	2.54
1	ALFA	A	ALTA	2,402,188	40,068,495.84	2.49
1	GISSA	A	MEDIA	5,751,583	137,980,476.17	8.56
1	GMD	*	MINIMA	3,781,043	64,277,731.00	3.99
1	KUO	B	MEDIA	5,396,741	273,506,833.88	16.97
1	ORBIA	*	ALTA	769,168	31,928,163.68	1.98
1	PASA	B	BAJA	2,291,600	38,498,880.00	2.39
1	PINFRA	*	ALTA	33,000	5,872,020.00	0.36
1	PINFRA	L	MEDIA	467,508	57,854,115.00	3.59
1	TMM	A	BAJA	500,000	3,210,000.00	0.20
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1	HOTEL	*	MEDIA	3,846,013	20,999,230.98	1.30
1	NEMAK	A	MEDIA	828,905	7,087,137.75	0.44
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1	BAFAR	B	BAJA	803,005	33,324,707.50	2.07
1	BIMBO	A	ALTA	913,000	32,630,620.00	2.02
1	CULTIBA	B	BAJA	13,147,439	157,769,268.00	9.79
1	KOF	UBL	ALTA	98,000	10,359,580.00	0.64
1	LALA	B	ALTA	300,000	5,649,000.00	0.35
1	MINSA	B	MINIMA	3,353,600	43,831,552.00	2.72
EMPRESAS DE SALUD						
1	FRAGUA	B	BAJA	481,875	110,831,250.00	6.88
1	MEDICA	B	BAJA	1,473,297	31,675,885.50	1.97
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
41	BBAJIO	O	ALTA	738,000	22,870,620.00	1.42
EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES						
1	TLEVISA	CPO	ALTA	650	27,612.00	0.00
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					1,570,676,800.39	97.46
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					1,570,676,800.39	97.46
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADO						
M	BONOS	220609	mxAAA	381,279	39,098,078.33	2.43
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					39,098,078.33	2.43
OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES						
PRESTAMISTA						
1	AEROMEX	*	MEDIA	3,457	51,509.30	0.00
1	FRAGUA	B	BAJA	3	690.00	0.00
1	TLEVISA	CPO	ALTA	17,000	722,160.00	0.04
1	TLEVISA	CPO	ALTA	25,000	1,062,000.00	0.07
TOTAL OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES					1,836,359.30	0.11
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					1,611,611,238.02	100.00

CATEGORÍA
DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
0.971%

Límite de VaR
1.290%

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