

gbmfondos

GBMMOD GBM FONDO DE INVERSION MODELO, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 31 OCTUBRE, 2019

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Titulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS MATERIALES						
1	CEMEX	CPO	ALTA	5,292,114	38,261,984.22	4.11
1	CYDSASA	A	BAJA	4,988,047	129,689,222.00	13.92
1	GMEXICO	B	ALTA	1,469,848	74,477,198.16	8.00
1	VITRO	A	MEDIA	501,525	21,289,736.25	2.29
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1	AEROMEX	*	MEDIA	696,862	10,383,243.80	1.11
1	AGUA	*	MEDIA	3,017,563	52,958,230.65	5.69
1	ALFA	A	ALTA	2,496,860	41,647,624.80	4.47
1	ARA	*	MEDIA	7,288,804	26,385,470.48	2.83
1	GISSA	A	MEDIA	2,353,876	56,469,485.24	6.06
1	GMXT	*	MEDIA	2,723,637	69,970,234.53	7.51
1	KUO	B	MEDIA	1,634,105	82,816,441.40	8.89
1	ORBITA	*	ALTA	1,059,206	43,967,641.06	4.72
1	PINFRA	*	ALTA	38,148	6,788,055.12	0.73
1	PINFRA	L	MEDIA	587,940	72,757,575.00	7.81
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1	BACHOCO	B	ALTA	215,425	18,608,411.50	2.00
1	BIMBO	A	ALTA	794,615	28,399,540.10	3.05
1	CULTIBA	B	BAJA	4,176,726	50,120,712.00	5.38
1	GRUMA	B	ALTA	31,631	6,384,717.35	0.69
1	KOF	UBL	ALTA	57,375	6,065,111.25	0.65
1	LALA	B	ALTA	447,905	8,434,051.15	0.91
EMPRESAS DE SALUD						
1	FRAGUA	B	BAJA	65,027	14,956,210.00	1.61
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1	R	A	ALTA	224,443	22,933,585.74	2.46
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					883,764,481.80	94.89
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					883,764,481.80	94.89
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADO						
M	BONOS	231207	mxAAA	153,217	16,585,067.07	1.78
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					16,585,067.07	1.78
OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES						
PRESTAMISTA						
1	CEMEX	CPO	ALTA	21,823	157,780.29	0.02
1	GRUMA	B	ALTA	500	100,925.00	0.01
1	GRUMA	B	ALTA	1,254	253,119.90	0.03
1	GRUMA	B	ALTA	15,000	3,027,750.00	0.33
1	GRUMA	B	ALTA	24,000	4,844,400.00	0.52
1	GRUMA	B	ALTA	10,000	2,018,500.00	0.22
1	GRUMA	B	ALTA	67,000	13,523,950.00	1.45
1	GRUMA	B	ALTA	20,200	4,077,370.00	0.44
1	GRUMA	B	ALTA	15,000	3,027,750.00	0.33
TOTAL OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES					31,031,545.19	3.33
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					931,381,094.06	100.00

CATEGORÍA
ESPECIALIZADA EN ACCIONES

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.384%

Límite de VaR
1.510%

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