GBMfondos

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

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS MATERIALES						
1	CEMEX	CPO	ALTA	5,062,114	35,839,767.12	4.03
1	CYDSASA	A	BAJA	4,740,047	123,241,222.00	13.86
1	GMEXICO	B	ALTA	1,397,848	72,492,397.28	8.15
1	VITRO	A	MEDIA	501,525	21,139,278.75	2.38
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1	AEROMEX	*	MEDIA	661,151	10,340,401.64	1.16
1	AGUA	*	MEDIA	2,953,012	47,425,372.72	5.33
1	ALFA	A	ALTA	2,383,860	37,378,924.80	4.20
1	ARA	*	MEDIA	6,140,979	25,669,292.22	2.89
1	GISSA	A	MEDIA	2,353,876	54,139,148.00	6.09
1	GMXT	*	MEDIA	2,723,637	68,390,525.07	7.69
1	KUO	B	MEDIA	1,634,105	91,346,469.50	10.27
1	ORBIA	*	ALTA	809,206	32,627,185.92	3.67
1	PINFRA	L	MEDIA	535,133	74,918,620.00	8.42
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1	BACHOCO	B	ALTA	231,625	18,861,223.75	2.12
1	BIMBO	A	ALTA	794,615	27,358,594.45	3.08
1	CULTIBA	B	BAJA	4,176,726	64,154,511.36	7.21
1	GRUMA	B	ALTA	2,407	467,270.91	0.05
1	LALA	B	ALTA	681,695	11,138,896.30	1.25
EMPRESAS DE SALUD						
1	FRAGUA	B	BAJA	65,027	15,931,615.00	1.79
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1	R	A	ALTA	87,243	9,260,844.45	1.04
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					**842,121,561.24**	**94.69**
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
BI	CETES	200130	mxAAA	200,000	1,988,708.60	0.22
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					**1,988,708.60**	**0.22**
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					**844,110,269.84**	**94.91**
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADOR						
M	BONOS	231207	mxAAA	146,527	15,436,171.19	1.74
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					**15,436,171.19**	**1.74**
OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES						
PRESTAMISTA						
1	CEMEX	CPO	ALTA	21,823	154,506.84	0.02
1	GRUMA	B	ALTA	67,000	13,006,710.00	1.46
1	GRUMA	B	ALTA	1,254	243,439.02	0.03
1	GRUMA	B	ALTA	20,200	3,921,426.00	0.44
1	GRUMA	B	ALTA	15,000	2,911,950.00	0.33
1	GRUMA	B	ALTA	15,000	2,911,950.00	0.33
1	GRUMA	B	ALTA	10,000	1,941,300.00	0.22
1	GRUMA	B	ALTA	500	97,065.00	0.01
1	GRUMA	B	ALTA	24,000	4,659,120.00	0.52
TOTAL OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES					**29,847,466.86**	**3.36**
TOTAL DE INVERSION EN VALORES					**889,393,907.89**	**100.00**

CATEGORÍA
ESPECIALIZADA EN ACCIONES

CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
	1.055%	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. Raymundo Leal Vargas