

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Valor Razonable	%
DIRECTO					
ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS					
1	LAMOS	*	MEDIA	249,397,344.00	9.98
1	KUO	B	BAJA	189,822,513.40	7.59
1	GISSA	A	MEDIA	153,059,634.38	6.12
1	FEMSA	UBD	ALTA	100,611,140.00	4.02
1	AGUILAS	CPO	MEDIA	100,046,088.00	4.00
1	SORIANA	B	BAJA	91,032,989.24	3.64
1	CULTIBA	B	BAJA	83,424,103.49	3.34
1	GMXT	*	MEDIA	80,827,533.28	3.23
1	WALMEX	*	ALTA	79,536,746.94	3.18
1	AGUA	*	MEDIA	76,764,904.48	3.07
1	GCC	*	ALTA	71,553,717.32	2.86
1	CYDSASA	A	MEDIA	61,802,439.14	2.47
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	60,931,200.00	2.44
1	OMA	B	ALTA	60,391,391.49	2.42
1				380,832,390.78	15.23
FIDEICOMISOS DE INFRAESTRUCTURA Y BIENES RAICES DE INVERSIÓN INMOBILIARIA					
CF	FNOVA	17	MEDIA	69,271,732.60	2.77
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO				1,909,305,868.54	76.38
PRESTAMO DE VALORES					
1	CEMEX	CPO	ALTA	101,184,000.00	4.05
1	GMEXICO	B	ALTA	94,221,000.00	3.77
1	ASUR	B	ALTA	90,978,900.00	3.64
1	GFNORTE	O	ALTA	89,546,694.35	3.58
1	FEMSA	UBD	ALTA	58,269,000.00	2.33
OTROS VALORES				156,381,756.03	6.26
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES				2,499,887,218.92	100.00
TOTAL PRESTAMO DE VALORES				434,199,594.35	17.37

CATEGORÍA
RVDIS

CALIFICACIÓN

VaR Promedio última semana
0.888%

Limite de VaR
1.840%

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

