



GBMINF GBM INVERSIÓN EN INFRAESTRUCTURA, S.A DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 28 SEPTIEMBRE, 2018

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS MATERIALES						
1	ALPEK	A	ALTA	566,830	17,299,651.60	3.05
1	CEMEX	CPO	ALTA	999,625	13,135,072.50	2.32
1	CYDSASA	A	BAJA	2,452,921	80,431,279.59	14.18
1	ELEMENT	*	MEDIA	1,104,841	13,700,028.40	2.42
1	GMEXICO	B	ALTA	487,008	26,274,081.60	4.63
1	MEXCHEM	*	ALTA	213,221	13,722,903.56	2.42
1	POCHTEC	B	BAJA	1,882,338	13,006,955.58	2.29
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1	AEROMEX	*	MEDIA	820,175	21,070,295.75	3.71
1	AGUA	*	MEDIA	858,196	19,772,835.84	3.49
1	ALFA	A	ALTA	445,818	10,757,588.34	1.90
1	ARA	*	MEDIA	2,700,780	18,257,272.80	3.22
1	GISSA	A	MEDIA	2,040,171	58,532,505.99	10.32
1	GMXT	*	ALTA	57,138	1,812,417.36	0.32
1	KUO	B	BAJA	2,063,853	99,064,944.00	17.46
1	PASA	B	BAJA	273,300	6,556,467.00	1.16
1	PINFRA	L	MEDIA	519,686	76,591,322.68	13.50
1	TRAXION	A	MEDIA	9,654	143,941.14	0.03
1	VINTE	*	BAJA	899,202	24,683,094.90	4.35
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1	HOTEL	*	MEDIA	2,229,716	22,743,103.20	4.01
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
FE	FCFE	18	MEDIA	316,113	5,658,422.70	1.00
EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES						
1	AMX	L	ALTA	936,576	14,086,103.04	2.48
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					557,300,287.57	98.25
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					557,300,287.57	98.25
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADO						
IS	BPA182	210909	mxAAA	29,478	2,969,120.82	0.52
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					2,969,120.82	0.52
OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES						
PRESTAMISTA						
1	ALPEK	A	ALTA	31,140	950,392.80	0.17
1	ALPEK	A	ALTA	460	14,039.20	0.00
1	TRAXION	A	MEDIA	402,351	5,999,053.41	1.06
TOTAL OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES					6,963,485.41	1.23
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					567,232,893.80	100.00

CLASIFICACIÓN
ESPECIALIZADA EN ACCIONES

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
0.964%

Límite de VaR
5.330%

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