



GBMINF GBM INVERSIÓN EN INFRAESTRUCTURA, S.A DE C.V., S.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 01 marzo, 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	1,457,246	36,110,555.88	5.27
1	CEMEX	CPO	ALTA	1,023,344	13,405,806.40	1.96
1	CYDSASA	A	BAJA	2,641,001	84,512,032.00	12.32
1	ELEMENT	*	MEDIA	1,122,351	26,218,119.36	3.82
1	GMEXICO	B	ALTA	787,559	48,931,040.67	7.14
1	MEXCHEM	*	ALTA	442,295	23,596,438.25	3.44
1	POCHTEC	B	BAJA	1,882,338	19,105,730.70	2.79
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1	AEROMEX	*	MEDIA	790,431	22,345,484.37	3.26
1	AGUA	*	MEDIA	879,075	25,194,289.50	3.67
1	ALFA	A	ALTA	542,535	12,207,037.50	1.78
1	ARA	*	MEDIA	2,793,058	20,165,878.76	2.94
1	GISSA	A	MEDIA	2,210,022	63,582,332.94	9.27
1	GMXT	*	ALTA	108,495	3,319,947.00	0.48
1	KUO	B	BAJA	2,188,504	91,917,168.00	13.40
1	PASA	B	MINIMA	273,300	6,613,860.00	0.96
1	PINFRA	L	MEDIA	243,708	32,315,680.80	4.71
1	TRAXION	A	MEDIA	421,759	6,305,297.05	0.92
1	VESTA	*	ALTA	426,100	10,920,943.00	1.59
1	VINTE	*	BAJA	899,202	22,929,651.00	3.34
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1	HOTEL	*	MEDIA	3,584,428	38,532,601.00	5.62
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
FE	FCFE	18	MEDIA	323,600	6,326,380.00	0.92
EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES						
1	AMX	L	ALTA	903,015	15,902,094.15	2.32
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					630,458,368.33	91.94
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					630,458,368.33	91.94
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADO						
LD	BONDESD	220113	mxAAA	38,927	3,878,434.90	0.57
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					3,878,434.90	0.57
OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES						
PRESTAMISTA						
1	AEROMEX	*	MEDIA	52,387	1,480,980.49	0.22
1	ALPEK	A	ALTA	10,000	247,800.00	0.04
1	AMX	L	ALTA	30,000	528,300.00	0.08
1	AMX	L	ALTA	122,425	2,155,904.25	0.31
1	AMX	L	ALTA	20,143	354,718.23	0.05
1	AMX	L	ALTA	2,000	35,220.00	0.01
1	AMX	L	ALTA	9,500	167,295.00	0.02
1	AMX	L	ALTA	10,300	181,383.00	0.03
1	AMX	L	ALTA	23,162	407,882.82	0.06
1	AMX	L	ALTA	11,729	206,547.69	0.03
1	AMX	L	ALTA	137,329	2,418,363.69	0.35
1	AMX	L	ALTA	8,066	142,042.26	0.02
1	ELEMENT	*	MEDIA	8,629	201,573.44	0.03
1	PINFRA	L	MEDIA	140,100	18,577,260.00	2.71
1	PINFRA	L	MEDIA	89,300	11,841,180.00	1.73
1	PINFRA	L	MEDIA	93,600	12,411,360.00	1.81
1	VESTA	*	ALTA	1,008	25,835.04	0.00
TOTAL OPERACIONES DE PRÉSTAMO DE VALORES					51,383,645.91	7.49
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					685,720,449.14	100.00

CLASIFICACIÓN
ESPECIALIZADA EN ACCIONES

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
0.665%

Límite de VaR
5.330%

Para llevar a cabo la estimación del Valor en Riesgo (VaR) de mercado para las Sociedades de Inversión administradas 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 período 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