

GBMfondos

GBMDOL GBM FONDO DE INVERSION EN DOLARES, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 06 JUNIO, 2019

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN						
CHD	BANAMEX	2531509		38,692,061	760,136,484.49	22.40
TOTAL DISPONIBILIDADES					760,136,484.49	22.40
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1ISP	BIL	*	ALTA	163,791	294,397,000.29	8.68
1ISP	FLOT	*	NA	266,903	266,370,966.24	7.85
1ISP	SHV	*	ALTA	22,090	47,945,637.77	1.41
1ISP	USFR	*	NA	520,372	256,600,418.36	7.56
1ISP	VCSH	*	NA	68,076	107,112,965.14	3.16
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					972,426,987.80	28.65
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
D1SP	UMS19F	2019F	BBB	32,266	678,221,960.38	19.99
D1SP	UMS22F	2022F	BBB	17,893	416,210,214.09	12.26
TÍTULOS BANCARIOS						
D2SP	BBVAB20	100321	BBB-	4,300	89,815,919.21	2.65
D2SP	BINBL53	240606	BBB+	500	9,833,160.84	0.29
D2SP	JPMQ65	200325	A-	1,000	20,225,547.56	0.60
D2SP	NAFIA24	201105	BBB+	9,000	178,055,048.31	5.25
D2SP	NAFI499	190705	A-2	5,000	98,041,984.76	2.89
PAPEL PRIVADO						
AIM	PGOLDMA	0103189		478,761	478,761.00	0.01
D2SP	CYDSA81	271004	BB	800	15,728,859.69	0.46
D2SP	GCCAB00	240623	BB+	2,000	40,718,539.94	1.20
D2SP	MXCHB45	061119	Baa3	200	4,041,159.61	0.12
D2SP	SIGMB54	161219	Baa3	100	2,072,570.51	0.06
D2SP	TERRA76	221110	Baa3	2,500	50,996,199.28	1.50
EAIM	FCSTONE	0002783		196,458	196,458.00	0.01
EAIM	PGOLDMA	0103189		17,111,490	17,111,490.00	0.50
91SP	BBVALMX	18D	AAA(mex)	20,000	39,287,758.10	1.16
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					1,661,035,631.28	48.95
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					2,633,462,619.08	77.60
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADO						
LD	BONDESD	210325	mxAAA	55	5,496.54	0.00
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					5,496.54	0.00
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					3,393,604,600.11	100.00

CLASIFICACIÓN DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.007%

Límite de VaR
3.200%

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