

# GBMfondos

GBMF2 GBM FONDO DE CORTO PLAZO, S.A. DE C.V., F.I.I.D.  
CARTERA DE VALORES AL 06 JUNIO, 2019

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
<b>DISPONIBILIDADES</b>						
<b>DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN</b>						
CHD	BANAMEX	3938506		34,749	682,671.71	0.01
<b>TOTAL DISPONIBILIDADES</b>					<b>682,671.71</b>	<b>0.01</b>
<b>TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>						
<b>INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA</b>						
<b>TÍTULOS BANCARIOS</b>						
F	BACOMER	18152	mxA-1+	500,000	50,165,259.50	0.97
F	BACOMER	18164	mxA-1+	500,000	50,011,816.50	0.97
F	BACOMER	18170	mxA-1+	800,000	80,287,376.00	1.55
F	BANORTE	18023	mxA-1+	550,000	55,130,088.20	1.06
F	BANORTE	18025	mxA-1+	900,000	90,214,229.70	1.74
F	BANORTE	18026	mxA-1+	1,000,000	100,239,539.00	1.94
F	BANORTE	18041	mxA-1+	800,000	80,428,928.80	1.55
F	BANORTE	19002	mxA-1+	700,000	70,248,931.90	1.36
F	BANSAN	18034	MX-1	1,100,000	110,574,385.90	2.14
F	BANSAN	18072	MX-1	1,000,000	100,023,688.00	1.93
F	BANSAN	18084	MX-1	1,000,000	100,666,456.00	1.94
F	BSCTIA	19001	mxA-1+	1,200,000	120,438,631.20	2.33
F	BSCTIA	19006	mxA-1+	1,000,000	100,213,888.00	1.94
94	BACOMER	16	Aaa.mx	500,000	50,104,773.50	0.97
<b>PAPEL PRIVADO</b>						
JI	CABEI	1-15	mxAAA	2,000,000	200,706,042.00	3.88
JI	CABEI	1-19	mxAAA	2,000,000	200,271,084.00	3.87
JI	CABEI	2-15	mxAAA	800,000	80,168,652.80	1.55
91	CETEMEM	17-2	mxAAA	500,000	50,294,769.00	0.97
91	DAIMLER	19-2	mxAAA	400,000	40,039,374.40	0.77
91	DHIC	15	AA(mex)	418,000	42,046,565.24	0.81
91	GBM	15	AA(mex)	750,000	75,185,491.50	1.45
91	GBM	16	AA(mex)	500,000	50,195,394.50	0.97
91	GBM	17	AA(mex)	207,583	20,846,871.93	0.40
91	NM	18-2	mxAA+	200,000	20,011,746.40	0.39
91	SORIANA	15	AA+(mex)	200,000	13,498,853.00	0.26
93	CETEMEM	00519	mxA-1+	293,118	29,414,432.92	0.57
95	FEFA	16	mxAAA	24,407	2,446,519.48	0.05
95	FEFA	18	mxAAA	78,700	7,915,344.42	0.15
<b>TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA</b>					<b>1,991,789,133.79</b>	<b>38.47</b>
<b>TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>					<b>1,991,789,133.79</b>	<b>38.47</b>
<b>OPERACIONES DE REPORTE</b>						
<b>REPORTADO</b>						
LD	BONDESD	210325	mxAAA	12,824,134	1,281,606,728.97	24.75
2U	CBIC003	210128	mxAAA	1,361,923	903,814,549.27	17.45
91	CETEMEM	19-2	mxAAA	1,949,088	200,047,215.49	3.86
94	BACOMER	18	Aaa.mx	1,063,881	106,436,088.13	2.06
94	BANORTE	18-2	mxAAA	995,694	100,102,182.13	1.93
94	BINBUR	18	mxAAA	1,215,358	121,975,094.58	2.36
94	BSMX	18	Aaa.mx	994,080	100,102,191.30	1.93
94	SCOTIAB	18	mxAAA	709,997	71,501,578.70	1.38
95	CIENCB	15	mxAAA	3,173,851	300,070,758.21	5.80
<b>TOTAL OPERACIONES DE REPORTE</b>					<b>3,185,656,396.78</b>	<b>61.52</b>
<b>TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES</b>					<b>5,178,128,202.28</b>	<b>100.00</b>

## CLASIFICACIÓN CORTO PLAZO

**CALIFICACIÓN**  
AAAf/S2(mex)

**VaR Promedio**  
0.000%

**Límite de VaR**  
0.250%

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