

GBMFONDOS

GBMF3 GBM VALORES DE DEUDA, S.A. DE C.V., F.I.I.D. CARTERA DE VALORES AL 20 JUNIO, 2019

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Titulos	Valor Razonable	Participación	Porcentual
DISPONIBILIDADES							
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN							
CHD	BANAMEX	3811506		852	16,179.80	0.00	
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA							
BI	CETES	190815	mxAAA	178,261	1,760,654.48	0.04	
TOTAL DISPONIBILIDADES					1,776,834.28	0.04	
TÍTULOS PARA NEGOCIAR							
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO							
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS							
1C	CORPTRC	ISHRS	BAJA	1,558,516	13,061,922.60	0.30	
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					13,061,922.60	0.30	
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA							
VALORES GUBERNAMENTALES							
BI	CETES	190815	mxAAA	821,739	8,116,180.52	0.19	
D1SP	UMS22F	2022F	BBB	8,500	191,409,271.58	4.43	
TÍTULOS BANCARIOS							
F	BACOMER	18152	mxA-1+	500,000	50,331,469.50	1.16	
F	BACOMER	18162	mxA-1+	1,000,000	100,520,168.00	2.32	
F	BACOMER	18164	mxA-1+	750,000	75,266,245.50	1.74	
F	BACOMER	18170	mxA-1+	600,000	60,016,015.90	1.39	
F	BANORTE	19008	mxA-1+	400,000	40,092,871.60	0.93	
F	BANORTE	19012	mxA-1+	500,000	50,029,523.00	1.16	
F	BANSAN	18059	MX-1	1,000,000	100,668,083.00	2.33	
F	BANSAN	18072	MX-1	500,000	50,177,912.50	1.16	
F	BANSAN	18094	MX-1	1,000,000	100,334,431.00	2.32	
F	BSCCTIA	19006	mxA-1+	1,000,000	100,548,383.00	2.32	
F	BSCCTIA	19016	mxA-1+	600,000	60,421,315.20	1.40	
F	HSBSCMX	18010	mxA-1+	1,000,000	100,348,177.00	2.32	
F	HSBSCMX	19009	mxA-1+	1,500,000	151,003,741.50	3.49	
F	HSBSCMX	19011	mxA-1+	300,000	30,011,664.30	0.69	
94	SCOTIAB	15-2	mxAAA	430,000	43,340,450.35	1.00	
PAPEL PRIVADO							
AIM	GBM	0777641		4,093,200	4,094,160.00	0.09	
AIM	PGOLDMA	0103193		10,298,305	10,298,305.00	0.24	
D2	CONM151	351215	mxAAA	1,000	12,937,313.91	0.30	
EAIM	FCSTONE	0002779		189,896	189,896.00	0.00	
EAIM	PGOLDMA	0103193		12,650,251	12,650,251.00	0.29	
JI	CABEI	1-10	mxAAA	755,033	76,515,657.31	1.77	
JI	CABEI	1-15	mxAAA	1,477,922	148,789,046.57	3.44	
JI	CABEI	1-17	mxAAA	797,601	80,222,339.29	1.85	
JI	CABEI	1-18	mxAAA	70,500	7,091,442.93	0.16	
JI	CABEI	1-19	mxAAA	1,500,000	150,794,815.50	3.49	
JI	CABEI	2-15	mxAAA	861,875	86,646,051.98	2.00	
90	FAMMCB	14U	mxAAA	111,808	88,815,205.79	1.99	
91	ARA	17	mxA+	450,000	45,707,733.45	1.06	
91	ATLASCB	19	HR AAA	200,000	20,158,652.60	0.47	
91	CETELEM	17-2	mxAAA	850,000	85,792,029.15	1.98	
91	DAIMLER	18-3	mxAAA	500,000	50,255,479.00	1.16	
91	DAIMLER	19-2	mxAAA	500,000	50,222,548.00	1.16	
91	DANHOS	16-2	AAA(mex)	32,403	3,251,465.91	0.08	
91	DHIC	15	AA(mex)	395,733	39,652,059.18	0.92	
91	FMCARCB	19	mxAA	100,000	10,009,429.70	0.23	
91	GBM	15	AA(mex)	1,000,000	99,901,452.00	2.31	
91	GBM	16	AA(mex)	815,448	81,580,678.08	1.89	
91	GBM	17	AA(mex)	207,583	20,772,786.39	0.48	
91	HOLCIM	15	mxAAA	1,201,392	120,591,662.25	2.79	
91	MONTRIO	14	HR AA	530,789	17,770,157.01	0.41	
91	MONTRIO	17	HR AA	197,000	19,862,470.63	0.46	
91	NM	18-2	mxAA+	600,000	60,242,736.60	1.39	
91	SIPYTCB	13	mxA	80,526	6,802,622.04	0.16	
91	SORIANA	15	AA+(mex)	700,000	47,081,288.10	1.09	
91	TLEVISA	14	Aa1.mx	392,000	39,217,039.85	0.91	
91	VWLEASE	15	mxAAA	300,000	30,207,666.60	0.70	
91	VWLEASE	17	mxAAA	197,000	19,843,489.88	0.46	
91	VWLEASE	18-2	mxAAA	250,000	25,145,034.00	0.58	
92	FEFA	02118	mxA-1+	24,625	2,467,320.39	0.06	
95	CEDEVIS	10-6U	mxAAA	59,994	5,607,255.52	0.13	
95	CFE	14	Aa1.mx	227,955	22,785,366.49	0.53	
95	CFE	15	Aa1.mx	300,000	30,066,562.50	0.70	
95	FEFA	16	mxAAA	2,100,000	211,204,377.30	4.88	
95	FEFA	17-2	mxAAA	500,000	50,180,431.50	1.16	
95	FEFA	18	mxAAA	409,837	41,082,522.36	0.95	
95	PEMEX	10-2	Aa3.mx	500,000	51,738,592.50	1.20	
95	PEMEX	16	AA(mex)	335,000	33,689,098.46	0.78	
95	TFOVICB	13-3U	mxAAA	133,904	33,806,654.50	0.78	
95	TFOVIS	14-2U	mxAAA	55,475	20,238,913.24	0.47	
97	BRHCCB	08U	Ba3.mx	144,300	2.74	0.00	
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					3,368,615,966.55	77.89	
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					3,381,677,889.15	78.19	
OPERACIONES DE REPORTE							
REPORTADO							
2U	CBIC003	210128	mxAAA	1,409,455	941,056,793.97	21.76	
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					941,056,793.97	21.76	
OPERACIONES CON DERIVADOS							
FUTUROS							
FB	DC24	SP19		540	-216,000.00	-0.01	
FB	DC24	SP19		540	-216,000.00	-0.01	
FCSP	FE	U9		430	857,203.20	0.02	
TOTAL OPERACIONES CON DERIVADOS					425,203.20	0.01	
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					4,324,936,720.60	100.00	

CLASIFICACIÓN DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN
AA1/S4(mex)

VaR Promedio
0.028%

Límite de VaR
0.530%

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