

# GBMfondos

## GBMGUB GBM FDO DE INSTRUMENTOS GUBERNAMENTALES, 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	3787508		9,984	196,143.65	0.01
<b>TOTAL DISPONIBILIDADES</b>					<b>196,143.65</b>	<b>0.01</b>
<b>TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>						
<b>INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA</b>						
<b>VALORES GUBERNAMENTALES</b>						
IM	BPAG28	190725	mxAAA	2,000,000	200,351,046.00	11.08
IQ	BPAG91	191219	mxAAA	1,000,000	101,755,630.00	5.63
LD	BONDES	190627	mxAAA	2,000,000	200,371,556.00	11.08
LD	BONDES	190808	mxAAA	2,000,000	201,010,756.00	11.11
LD	BONDES	191024	mxAAA	2,080,691	208,089,723.81	11.51
LD	BONDES	191205	mxAAA	1,000,000	100,330,632.00	5.55
S	UDIBONO	190613	mxAAA	32,284	20,605,891.89	1.14
<b>TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA</b>					<b>1,032,515,235.70</b>	<b>57.09</b>
<b>TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>					<b>1,032,515,235.70</b>	<b>57.09</b>
<b>OPERACIONES DE REPORTE</b>						
<b>REPORTADO</b>						
LD	BONDES	210325	mxAAA	7,764,153	775,926,914.80	42.90
<b>TOTAL OPERACIONES DE REPORTE</b>					<b>775,926,914.80</b>	<b>42.90</b>
<b>TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES</b>					<b>1,808,638,294.15</b>	<b>100.00</b>

### CLASIFICACIÓN DISCRECIONAL EN GUBERNAMENTAL

**CALIFICACIÓN**  
AAA+/S3(mex)

**VaR Promedio**  
0.001%

**Límite de VaR**  
0.110%

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