

GBMfondos

GBMPAT GBM FONDO PATRIMONIAL, 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
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN						
CHD	BANAMEX	3788504		5,672	111,430.76	0.00
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA						
BI	CETES	190815	mxAAA	273,251	2,689,568.88	0.07
TOTAL DISPONIBILIDADES					2,800,999.64	0.07
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
BI	CETES	190815	mxAAA	726,749	7,153,282.12	0.19
D1SP	UMS2ZF	2022F	BBB	8,500	197,719,042.07	5.13
M	BONOS	290531	mxAAA	150,000	16,115,761.95	0.42
TÍTULOS BANCARIOS						
F	BACOMER	18162	mxA-1+	200,000	20,066,103.80	0.52
F	BACOMER	18162	mxA-1+	1,500,000	150,282,670.50	3.90
F	BANORTE	18026	mxA-1+	1,500,000	150,359,308.50	3.90
F	BANORTE	19002	mxA-1+	500,000	50,177,208.50	1.30
F	BANSAN	18059	MX-1	500,000	50,166,288.00	1.30
F	BSCTIA	18040	mxA-1+	500,000	50,206,794.50	1.30
F	BSCTIA	18044	mxA-1+	2,000,000	200,155,708.00	5.19
F	BSCTIA	19006	mxA-1+	500,000	50,106,944.00	1.30
F	HSBSCMX	18010	mxA-1+	1,000,000	100,681,428.00	2.61
F	HSBSCMX	19009	mxA-1+	1,500,000	150,500,430.00	3.91
F	HSBSCMX	19011	mxA-1+	250,000	25,093,517.25	0.65
91	PORCS	19	AA+(mex)	500,000	50,973,853.50	1.32
94	BACOMER	10	Aaa,mx	140,000	14,137,820.06	0.37
94	SCOTIAB	15-2	mxAAA	248,047	24,917,774.95	0.65
PAPEL PRIVADO						
AIM	GBM	0778088		6,253,500	6,254,952.00	0.16
AIM	PGOLDMA	0103190		10,711,861	10,711,861.00	0.28
D2	CONM151	351215	mxAAA	1,650	21,359,905.51	0.55
D2	REDCS33	290610	BBB	3,000	30,607,326.56	0.79
EAM	FCSTONE	0002784		196,457	196,457.00	0.01
EAM	PGOLDMA	0103190		7,300,053	7,300,053.00	0.19
JE	AMX	0619	mxAAA	20,026	206,236,004.36	5.35
JI	CABEI	1-15	mxAAA	1,000,000	100,353,021.00	2.60
JI	CABEI	1-19	mxAAA	1,000,000	100,135,542.00	2.60
JI	CABEI	2-15	mxAAA	500,000	50,105,408.00	1.30
90	PAIMM3B	14U	mxAAA	92,127	54,826,086.82	1.42
91	AGUA	17X	mxAA-	376,000	37,704,021.53	0.98
91	AMX	10-2	mxAAA	47,800	4,883,678.82	0.13
91	ATLASCB	18	mxAA-	50,000	5,037,427.25	0.13
91	BBVALMX	13-2	AA+(mex)	102,306	10,195,561.92	0.26
91	CETELEM	17	mxAAA	521,677	52,450,650.30	1.36
91	CETELEM	17-2	mxAAA	200,000	20,117,907.60	0.52
91	DAMLER	19-3	mxAAA	300,000	30,049,857.30	0.78
91	DAMLER	19	mxAAA	350,000	35,845,069.75	0.93
91	DAMLER	19-2	mxAAA	400,000	40,039,374.40	1.04
91	DHIC	15	AA+(mex)	300,000	30,176,960.70	0.78
91	FINCARCB	19	mxAA	100,000	10,064,848.50	0.26
91	GAP	15	mxAAA	753,011	75,865,813.07	1.97
91	GBM	15	AA+(mex)	229,900	23,046,859.33	0.60
91	GBM	17	AA+(mex)	1,245,500	125,081,432.43	3.25
91	HOLCIM	12-3	mxAAA	249,313	25,813,591.03	0.67
91	MONTPIO	14	HR AA	286,958	9,645,197.86	0.25
91	MONTPIO	17	HR AA	300,000	30,124,147.20	0.78
91	NI	19-2	mxAA+	300,000	30,017,619.60	0.78
91	OMA	14	AA+(mex)	28,622	2,853,337.66	0.07
91	RCO	12	mxAAA	8,802	862,050.92	0.02
91	SCRECB	16-2	mxAAA	200,000	18,524,376.00	0.48
91	SIPYTCB	13	mxA	76,782	6,347,003.82	0.16
91	SORIANA	15	AA+(mex)	598,662	40,406,251.67	1.05
91	SORIANA	16	AA+(mex)	2,980	201,067.66	0.01
91	TIPCB	17	AA+(mex)	72,958	7,287,403.13	0.19
91	TLEVISIA	14	Aa1,mx	250,000	24,913,929.75	0.65
91	TOYOTA	14	mxAAA	483,219	24,172,002.18	0.63
91	UFNCB	16	mxAAA	6,000	506,212.59	0.01
91	VVLEAS	15	mxAAA	150,000	15,051,686.10	0.39
92	FEFA	01019	mxA-1+	49,386	4,939,835.24	0.13
95	CFE	15	Aa1,mx	250,000	24,983,679.75	0.65
95	CFECB	09	Aa1,mx	3,025,229	15,613,346.03	0.41
95	FEFA	15-8	mxAAA	300,000	30,237,077.10	0.78
95	FEFA	16	mxAAA	1,345,705	134,891,363.17	3.50
95	FEFA	17-2	mxAAA	714,440	71,954,362.36	1.87
95	FEFA	17-4	mxAAA	70,988	7,117,309.59	0.18
95	IFCOTCB	17	AA+(mex)	1,000,000	101,124,662.00	2.62
95	PEMEX	09U	Aa3,mx	14,155	8,570,072.66	0.22
95	PEMEX	10U	Aa3,mx	62,453	39,392,523.34	1.02
95	PEMEX	10-2	Aa3,mx	1,070,472	110,270,823.66	2.86
95	PEMEX	16	AA+(mex)	1,320,000	133,307,313.48	3.46
95	TFOVICB	13-3U	mxAAA	99,236	24,914,230.05	0.65
95	TFOVIS	11-3U	mxAAA	428,143	36,195,237.05	0.94
95	TFOVIS	13-2U	mxAAA	100,000	19,079,108.90	0.50
95	TFOVIS	14U	Aaa,mx	55,253	18,613,990.01	0.48
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					3,415,490,463.01	88.62
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					436,778,904.05	11.33
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADO						
91	CETELEM	19	mxAAA	497,466	50,011,790.35	1.30
91	FUNO	17-2	AA+(mex)	297,878	30,007,005.82	0.78
91	FUNO	18	AA+(mex)	349,072	35,008,244.43	0.91
94	BACOMER	18	Aaa,mx	654,451	68,475,978.74	1.78
94	BANORTE	18-2	mxAAA	640,583	64,401,067.12	1.67
94	BINBUR	18	mxAAA	781,904	78,473,021.40	2.04
94	BSIX	18	Aaa,mx	639,544	64,401,009.81	1.67
94	SCOTIAB	18	mxAAA	456,779	46,000,785.38	1.19
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					436,778,904.05	11.33
OPERACIONES CON DERIVADOS						
FUTUROS						
FB	DC24	JN19		825	103,125.00	0.00
FB	DC24	JN19		825	103,125.00	0.00
FCSP	PE	M9		133	-378,871.31	-0.01
FCSP	PE	M9		77	-219,346.55	-0.01
FCSP	PE	M9		62	-176,616.70	0.00
FCSP	PE	M9		111	-316,200.87	-0.01
FCSP	PE	M9		46	-131,036.20	0.00
FCSP	RX	U9		5	-25,467.27	0.00
FCSP	US	U9		2	-4,911.45	0.00
TOTAL OPERACIONES CON DERIVADOS					-1,046,202.35	-0.03
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					3,854,024,164.35	100.00

CLASIFICACIÓN DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Limite de VaR
AAAI/SS(mex)	0.034%	0.490%

Para llevar a cabo la estimación del Valor en Riesgo (VaR) de mercado para las Fondos de Inversión administrados por Operadores 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 Operación.

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