

GBMfondos

GBMDOL GBM FONDO DE INVERSIÓN EN DOLARES, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 02 MAYO, 2019

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN						
CHD	BANAMEX	2531509		30,592,584	584,960,803.21	16.77
TOTAL DISPONIBILIDADES					584,960,803.21	16.77
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
11SP	BIL	*	ALTA	163,791	286,376,154.69	8.21
11SP	FLOT	*	NA	266,903	259,612,616.62	7.44
11SP	SHV	*	ALTA	22,090	46,622,623.40	1.34
11SP	SHY	*	ALTA	59,956	96,115,741.80	2.76
11SP	USFR	*	NA	520,372	249,845,328.93	7.16
11SP	VCSH	*	NA	68,076	103,340,470.15	2.96
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					1,041,912,935.59	29.88
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
D1SP	UMS19F	2019F	BBB+	32,966	671,813,407.11	19.26
D1SP	UMS22F	2022F	BBB+	20,640	460,623,115.56	13.21
TÍTULOS BANCARIOS						
D2SP	BBVAB20	100321	BBB-	4,300	87,056,452.37	2.50
D2SP	BINBL53	240606	BBB+	500	9,743,523.82	0.28
D2SP	JPMQ65	200325	A-	1,000	19,610,402.00	0.56
D2SP	NAFIA24	201105	BBB+	9,000	175,706,448.45	5.04
PAPEL PRIVADO						
AIM	PGOLDMA	0103189		1,466,327	1,466,327.00	0.04
D2SP	AMXLX39	161019	A-	1,170	22,486,944.91	0.64
D2SP	CYDSA81	271004	BB	2,300	43,453,846.56	1.25
D2SP	DAIGY22	210222	A-	2,000	38,448,651.91	1.10
D2SP	GCCAB00	240623	BB+	2,000	39,594,414.31	1.14
D2SP	MSG89	190513	BBB+	8,100	160,330,674.90	4.60
D2SP	MXCHB45	061119	Baa3	200	4,122,987.93	0.12
D2SP	SIGMB54	161219	Baa3	100	2,009,781.72	0.06
D2SP	TERRA76	221110	Baa3	2,500	50,327,622.45	1.44
EAIM	FCSTONE	0002783		191,210	191,210.00	0.01
EAIM	PGOLDMA	0103189		16,130,007	16,130,007.00	0.46
91SP	BBVALMX	18D	AAA(mex)	20,000	38,424,640.48	1.10
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					1,841,540,458.48	52.80
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					2,883,453,394.07	82.68
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADO						
LD	BONDESD	240229	mxAAA	191,335	19,028,178.41	0.55
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					19,028,178.41	0.55
OPERACIONES CON DERIVADOS						
FUTUROS						
FCSP	US	M9		2	20,316.06	0.00
FCSP	US	M9		2	20,316.06	0.00
FCSP	US	M9		1	10,158.03	0.00
FCSP	US	M9		2	20,316.06	0.00
FCSP	US	M9		6	60,948.19	0.00
FCSP	US	M9		1	10,158.03	0.00
OPCIONES						
OCSP	USM9	C14800		5	-38,839.53	0.00
TOTAL OPERACIONES CON DERIVADOS					103,372.90	0.00
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					3,487,545,748.59	100.00

CLASIFICACIÓN DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.067%

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