

GBMfondos

GBMF2 GBM FONDO DE CORTO PLAZO, S.A. DE C.V., F.I.I.D. 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	3938506		34,749	664,435.44	0.01
TOTAL DISPONIBILIDADES					664,435.44	0.01
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
TÍTULOS BANCARIOS						
F	BACOMER	18152	mxA-1+	500,000	50,082,550.00	0.84
F	BACOMER	18164	mxA-1+	500,000	50,259,507.00	0.84
F	BACOMER	18170	mxA-1+	800,000	80,157,727.20	1.34
F	BANAMEX	7441	mxA-1+	2,000,000	201,084,154.00	3.36
F	BANORTE	18023	mxA-1+	550,000	55,038,771.70	0.92
F	BANORTE	18025	mxA-1+	900,000	90,065,437.20	1.50
F	BANORTE	19002	mxA-1+	700,000	70,132,627.60	1.17
F	BANSAN	18034	MX-1	1,100,000	110,292,383.30	1.84
F	BANSAN	18072	MX-1	1,000,000	100,520,234.00	1.68
F	BANSAN	18084	MX-1	1,000,000	100,499,982.00	1.68
F	BSCTIA	19001	mxA-1+	1,200,000	120,243,382.80	2.01
F	HSBCMX	19011	mxA-1+	1,000,000	100,190,795.00	1.67
94	BACOMER	16	Aaa.mx	500,000	50,033,784.50	0.84
PAPEL PRIVADO						
J1	CABEI	1-15	mxAAA	2,000,000	200,417,388.00	3.35
J1	CABEI	2-15	mxAAA	800,000	80,581,279.20	1.35
91	CETELEM	17-2	mxAAA	500,000	50,185,449.00	0.84
91	DAIMLER	17	mxAAA	568,700	56,976,280.36	0.95
91	DAIMLER	19-2	mxAAA	400,000	40,247,107.60	0.67
91	DHIC	15	AA(mex)	418,000	41,929,376.02	0.70
91	GBM	15	AA(mex)	750,000	75,047,490.00	1.25
91	GBM	16	AA(mex)	500,000	50,102,907.50	0.84
91	GBM	17	AA(mex)	207,583	20,810,760.38	0.35
91	NM	18-2	mxAA+	200,000	20,115,415.60	0.34
91	SORIANA	15	AA+(mex)	200,000	13,463,072.00	0.22
93	DAIMLER	01019	mxA-1+	896,050	89,480,602.27	1.49
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					1,917,958,464.23	32.02
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					1,917,958,464.23	32.02
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADO						
LD	BONDES	231221	mxAAA	10,582,255	1,056,419,130.37	17.64
2U	CBIC002	300117	mxAAA	3,159,594	2,364,575,458.09	39.48
94	BACOMER	18	Aaa.mx	941,861	94,705,228.04	1.58
94	BANORTE	18-2	mxAAA	923,847	92,629,796.61	1.55
94	BINBUR	18	mxAAA	396,874	39,763,350.21	0.66
94	BSMX	18	Aaa.mx	942,071	94,705,179.59	1.58
95	CFE	10-2	Aa1.mx	266,606	28,277,490.58	0.47
95	CIENCB	15	mxAAA	3,242,532	300,070,192.60	5.01
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					4,071,145,826.09	67.97
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					5,989,768,725.76	100.00

CLASIFICACIÓN CORTO PLAZO

CALIFICACIÓN
AAA/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