

GBMfondos

GBMF3 GBM VALORES DE DEUDA, 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	3811506		3,475,018	66,445,819.68	1.62
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA						
BI	CETES	190509	mxAAA	187,915	1,876,584.02	0.05
TOTAL DISPONIBILIDADES					68,322,403.70	1.67
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
IC	CORPTRC	ISHRS	BAJA	1,558,516	13,122,704.72	0.32
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					13,122,704.72	0.32
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
BI	CETES	190509	mxAAA	812,085	8,109,760.98	0.20
TÍTULOS BANCARIOS						
F	BACOMER	18152	mxA-1+	500,000	50,082,550.00	1.22
F	BACOMER	18162	mxA-1+	1,000,000	100,023,154.00	2.45
F	BACOMER	18164	mxA-1+	750,000	75,389,260.50	1.84
F	BACOMER	18170	mxA-1+	600,000	60,118,295.40	1.47
F	BANAMEX	7441	mxA-1+	2,000,000	201,084,154.00	4.92
F	BANORTE	19002	mxA-1+	900,000	90,170,521.20	2.20
F	BANORTE	19008	mxA-1+	400,000	40,161,144.40	0.98
F	BANORTE	19012	mxA-1+	1,100,000	110,234,551.90	2.70
F	BANSAN	18059	MX-1	1,000,000	100,167,368.00	2.45
F	BANSAN	19072	MX-1	500,000	50,260,117.00	1.23
F	BANSAN	18084	MX-1	1,000,000	100,499,982.00	2.46
F	BSCTIA	19016	mxA-1+	1,000,000	100,183,786.00	2.45
F	HSBCMX	18010	mxA-1+	1,000,000	100,500,947.00	2.46
F	HSBCMX	19009	mxA-1+	1,500,000	150,249,972.00	3.67
F	HSBCMX	19011	mxA-1+	300,000	30,057,238.50	0.74
94	SCOTIAB	15-2	mxAAA	430,000	43,390,867.42	1.06
PAPEL PRIVADO						
AIM	GBM	0777641		4,363,200	4,364,205.00	0.11
AIM	PGOLDMA	0103193		5,654,544	5,654,544.00	0.14
D2	CONM151	351215	mxAAA	1,000	12,760,689.76	0.31
EAIM	FCSTONE	0002779		191,208	191,208.00	0.00
EAIM	PGOLDMA	0103193		19,695,766	19,695,766.00	0.48
JE	AMX	0619	mxAAA	6,826	69,703,055.78	1.70
JI	CABEI	1-10	mxAAA	755,033	75,308,944.37	1.87
JI	CABEI	1-15	mxAAA	1,477,922	148,100,633.45	3.62
JI	CABEI	1-17	mxAAA	797,601	79,881,961.47	1.95
JI	CABEI	1-18	mxAAA	70,500	7,051,425.09	0.17
JI	CABEI	2-15	mxAAA	861,975	86,813,737.51	2.12
90	PAMMCB	14U	mxAAA	111,808	65,745,025.09	1.61
91	ARA	17	mxA+	450,000	45,417,366.45	1.11
91	CETELM	17-2	mxAAA	850,000	85,315,263.30	2.09
91	DAIMLER	17	mxAAA	660,000	66,123,342.78	1.62
91	DAIMLER	18-3	mxAAA	500,000	50,322,073.50	1.23
91	DAIMLER	19-2	mxAAA	500,000	50,308,884.50	1.23
91	DANHOS	16-2	AAA(mex)	32,403	3,257,725.04	0.08
91	DHIC	15	AA(mex)	395,733	39,695,784.11	0.97
91	FMCARCB	19	mxAA	100,000	10,049,216.80	0.25
91	GBM	15	AA(mex)	1,000,000	100,063,320.00	2.45
91	GBM	16	AA(mex)	815,448	81,712,631.43	2.00
91	GBM	17	AA(mex)	207,583	20,810,760.38	0.51
91	HOLCIM	15	mxAAA	1,196,392	119,296,140.84	2.92
91	MONTPIO	14	HR AA	530,789	17,807,129.12	0.44
91	MONTPIO	17	HR AA	197,000	19,742,012.61	0.48
91	NM	18-2	mxAA+	600,000	60,346,246.80	1.48
91	PCARFM	15	mxAAA	357,883	17,942,556.90	0.44
91	SIPYICB	13	mxA	80,526	8,554,760.76	0.16
91	SORIANA	15	AA+(mex)	400,000	26,926,144.00	0.66
91	TLEVISA	14	Aa1.mx	392,000	38,987,063.64	0.95
91	VWLEASE	15	mxAAA	300,000	30,051,267.60	0.73
91	VWLEASE	17	mxAAA	197,000	19,732,001.27	0.48
91	VWLEASE	18-2	mxAAA	250,000	25,186,447.75	0.62
92	FEFA	02118	mxA-1+	24,625	2,471,439.24	0.06
95	CEDEVIS	10-6U	mxAAA	59,994	5,538,515.23	0.14
95	CFE	14	Aa1.mx	227,955	22,826,034.34	0.56
95	CFE	15	Aa1.mx	300,000	30,112,063.80	0.74
95	FEFA	16	mxAAA	100,000	10,008,431.70	0.24
95	FEFA	18	mxAAA	409,837	41,149,370.87	1.01
95	PEMEX	16	Aa3.mx	335,000	33,787,519.11	0.83
95	TFOVICB	13-3U	mxAAA	133,904	34,060,714.71	0.83
95	TFOVIS	14-2U	mxAAA	55,475	20,073,456.28	0.49
97	BRHCCB	08U	Ba3.mx	144,300	2.74	0.00
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					3,122,629,653.42	76.36
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					3,135,752,358.14	76.68
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADO						
ZU	CBIC002	300117	mxAAA	1,184,000	886,081,358.04	21.67
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					886,081,358.04	21.67
OPERACIONES CON DERIVADOS						
FUTUROS						
FB	DC24	JN19		540	67,500.00	0.00
FB	DC24	JN19		540	67,500.00	0.00
FCSP	PE	M9		178	-816,902.75	-0.02
FCSP	US	M9		2	20,316.06	0.00
FCSP	US	M9		1	10,158.03	0.00
FCSP	US	M9		3	30,474.09	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
OPCIONES						
OCSP	USM9	C14800		5	-38,839.53	0.00
TOTAL OPERACIONES CON DERIVADOS					-568,371.82	-0.01
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					4,089,587,748.06	100.00

CLASIFICACIÓN DISCRECIONAL

CALIFICACION
AA1/S4(mex)

VaR Promedio
0.018%

Limite de VaR
0.530%

Para llevar a cabo la estimación del Valor en Riesgo (VaR) de mercado para los 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 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