

GBMfondos

GBMGUB GBM FDO DE INSTRUMENTOS GUBERNAMENTALES, 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 | 3787508 | | 9,984 | 190,904.04 | 0.01 |
| TOTAL DISPONIBILIDADES | | | | | 190,904.04 | 0.01 |
| TÍTULOS PARA NEGOCIAR | | | | | | |
| INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA | | | | | | |
| VALORES GUBERNAMENTALES | | | | | | |
| IM | BPAG28 | 190725 | mxAAA | 2,000,000 | 200,016,750.00 | 12.27 |
| LD | BONDES | 190606 | mxAAA | 500,000 | 50,252,854.50 | 3.08 |
| LD | BONDES | 190627 | mxAAA | 2,000,000 | 200,039,536.00 | 12.27 |
| LD | BONDES | 190808 | mxAAA | 2,000,000 | 200,724,412.00 | 12.32 |
| LD | BONDES | 191024 | mxAAA | 2,080,691 | 209,088,671.88 | 12.83 |
| LD | BONDES | 191205 | mxAAA | 1,000,000 | 100,162,433.00 | 6.15 |
| S | UDIBONO | 190613 | mxAAA | 32,284 | 20,437,988.01 | 1.25 |
| TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA | | | | | 980,722,645.39 | 60.17 |
| TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR | | | | | 980,722,645.39 | 60.17 |
| OPERACIONES DE REPORTE | | | | | | |
| REPORTADO | | | | | | |
| LD | BONDES | 240229 | mxAAA | 6,525,314 | 648,939,498.70 | 39.82 |
| TOTAL OPERACIONES DE REPORTE | | | | | 648,939,498.70 | 39.82 |
| TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES | | | | | 1,629,853,048.13 | 100.00 |

CLASIFICACIÓN DISCRECIONAL EN GUBERNAMENTAL

CALIFICACIÓN
AAA/i/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