

GBMfondos

GBMGUBL GBM FONDO GUBERNAMENTAL DE LIQUIDEZ INMEDIATA, 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
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
LD	BONDESD	190808	mxAAA	1,500,000	150,543,309.00	4.76
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					150,543,309.00	4.76
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					150,543,309.00	4.76
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADO						
LD	BONDESD	231101	mxAAA	2,619,340	260,984,492.84	8.25
LD	BONDESD	231221	mxAAA	17,228,181	1,719,877,284.18	54.39
LD	BONDESD	240229	mxAAA	10,367,070	1,031,000,379.26	32.60
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					3,011,862,156.28	95.24
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					3,162,405,465.28	100.00

CLASIFICACIÓN CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL

CALIFICACIÓN
AAAf/S1(mex)

VaR Promedio
0.000%

Límite de VaR
0.030%

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