

GBMfondos

GBMM3 GBM FONDO PARA PERSONAS MORALES EXENTAS, 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 SIN RESTRICCIÓN						
CHD	BANAMEX	3795519		3,345,230	63,964,145.05	1.82
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA						
BI	CETES	190509	mxAAA	107,877	1,077,296.94	0.03
TOTAL DISPONIBILIDADES					65,041,441.99	1.85
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSION EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
BI	CETES	190509	mxAAA	892,123	8,909,048.06	0.25
TÍTULOS BANCARIOS						
F	BACOMER	18152	mxA-1+	500,000	50,082,550.00	1.42
F	BACOMER	18162	mxA-1+	1,000,000	100,023,154.00	2.85
F	BACOMER	18164	mxA-1+	750,000	75,389,260.50	2.14
F	BACOMER	18170	mxA-1+	600,000	60,118,295.40	1.71
F	BANAMEX	7441	mxA-1+	2,000,000	201,084,154.00	5.72
F	BANORTE	18023	mxA-1+	550,000	55,038,771.70	1.57
F	BANORTE	18025	mxA-1+	900,000	90,065,437.20	2.56
F	BANORTE	19012	mxA-1+	900,000	90,191,906.10	2.57
F	BANSAN	18034	MX-1	1,000,000	100,285,803.00	2.85
F	BANSAN	18059	MX-1	500,000	50,083,684.00	1.42
F	BANSAN	18072	MX-1	500,000	50,260,117.00	1.43
F	BSCTIA	19016	mxA-1+	1,000,000	100,183,786.00	2.85
F	HSBCEM	18010	mxA-1+	1,000,000	100,500,947.00	2.86
F	HSBCEM	19009	mxA-1+	1,500,000	150,249,972.00	4.27
F	HSBCEM	19011	mxA-1+	250,000	25,047,698.75	0.71
94	BANORTE	18	mxAAA	274,500	27,567,719.60	0.78
PAPEL PRIVADO						
AIM	GBM	0777687		2,504,800	2,505,377.00	0.07
AIM	FGOLDMA	0103194		5,369,163	5,369,163.00	0.15
D2	CONM151	351215	mxAAA	1,000	12,760,689.76	0.36
EAIM	FCSTONE	0002781		191,208	191,208.00	0.01
EAIM	FGOLDMA	0103194		20,637,032	20,637,032.00	0.59
JE	AMX	0619	mxAAA	5,000	51,057,028.85	1.45
90	PAMMCB	14U	mxAAA	56,139	33,010,696.58	0.94
91	ARA	17	mxA+	400,000	40,370,992.40	1.15
91	CETEMEM	17-2	mxAAA	545,480	54,734,187.60	1.56
91	CETEMEM	17-2	mxAAA	350,000	35,129,814.30	1.00
91	DAIMLER	17	mxAAA	384,129	38,480,949.52	1.04
91	DAIMLER	18-3	mxAAA	500,000	50,322,073.50	1.43
91	DAIMLER	19-2	mxAAA	200,000	20,123,553.80	0.57
91	DHIC	15	AA(mex)	380,000	38,117,614.56	1.08
91	FMCARCB	19	mxAA	100,000	10,049,216.80	0.29
91	GAP	15	mxAAA	843,038	84,799,945.57	2.41
91	HOLCIM	15	mxAAA	754,331	75,850,795.70	2.16
91	MONTPIO	14	HR AA	450,000	15,096,786.30	0.43
91	NM	18-2	mxAA+	500,000	50,288,539.00	1.43
91	SIPYTCB	13	mxA	75,989	6,185,652.09	0.18
91	SORIANA	15	AA+(mex)	450,000	30,291,912.00	0.86
91	TLEVISIA	14	Aa1.mex	350,000	34,809,878.25	0.99
91	TOYOTA	14	mxAAA	400,000	20,112,766.00	0.57
91	VWLEASE	15	mxAAA	346,000	34,659,128.63	0.99
91	VWLEASE	17-2	mxAAA	217,726	21,857,863.68	0.62
91	VWLEASE	18-2	mxAAA	220,000	22,164,074.02	0.63
91	ZONALCB	06U	AA(mex)	13,754	3,788,535.20	0.11
91	ZONALCB	06-2U	AA(mex)	4,256	1,809,492.47	0.05
91	ZONALCB	06-3U	AA(mex)	4,573	2,239,653.43	0.06
95	CDVITOT	14U	Aaa.mex	126,994	29,725,053.04	0.85
95	CEDEVIS	10-6U	mxAAA	35,996	3,323,072.21	0.09
95	CPE	15	Aa1.mex	264,199	26,518,290.48	0.75
95	FEFA	17-7	mxAAA	800,000	80,092,655.20	2.28
95	FEFA	18	mxAAA	359,025	36,047,630.63	1.03
95	FNCOB	18	AAA(mex)	278,797	27,958,013.80	0.80
95	IFCOTCB	17	AAA(mex)	500,000	50,496,783.00	1.44
95	PEMEX	16	Aa3.mex	1,081,000	108,027,785.55	3.10
95	TFOVICB	13-3U	mxAAA	211,181	53,717,407.95	1.53
95	TFOVIS	11-3U	mxAAA	32,304	2,899,147.97	0.08
95	TFOVIS	13-2U	mxAAA	100,000	19,538,640.20	0.56
95	TFOVIS	14U	Aaa.mex	96,970	32,844,060.84	0.93
95	TFOVIS	14-2U	mxAAA	39,493	14,290,419.27	0.41
97	BRHCCB	08U	Ba3.mex	72,393	1.38	0.00
TOTAL INVERSION EN TÍTULOS DE DEUDA					2,636,346,096.04	74.99
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					2,636,346,096.04	74.99
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADO						
91	CETEMEM	19-2	mxAAA	493,861	50,011,672.60	1.42
93	VWLEASE	02319	mxA-1+	500,803	50,011,683.03	1.42
93	VWLEASE	02519	mxA-1+	802,595	80,018,642.79	2.28
94	BACOMER	18	Aaa.mex	1,438,945	144,687,607.16	4.12
94	BANORTE	18-2	mxAAA	1,411,422	141,516,650.26	4.03
94	BINBUR	18	mxAAA	606,331	60,749,134.22	1.73
94	BSMX	18	Aaa.mex	1,439,266	144,687,550.11	4.12
95	CPE	10-2	Aa1.mex	407,313	43,201,539.05	1.23
95	CPE	17	mxAAA	1,081,254	100,023,291.80	2.85
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					814,907,871.02	23.18
OPERACIONES CON DERIVADOS						
FUTUROS						
FB	DC24	JN19		310	38,750.00	0.00
FB	DC24	JN19		310	38,750.00	0.00
FCSP	PE	M9		174	-798,545.39	-0.02
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		4	40,632.13	0.00
FCSP	US	M9		2	20,316.06	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					-637,988.55	-0.02
TOTAL DE INVERSION EN VALORES					3,515,657,420.50	100.00

CLASIFICACIÓN
DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN
AAI/S4(mex)

VaR Promedio
0.018%

Límite de VaR
0.510%

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