

# GBMfondos

## GBMF2 GBM FONDO DE CORTO PLAZO, S.A. DE C.V., F.I.I.D. CARTERA DE VALORES AL 30 ABRIL, 2019

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
<b>DISPONIBILIDADES</b>						
<b>DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN</b>						
CHD	BANAMEX	3938506		34,749	658,243.17	0.01
<b>TOTAL DISPONIBILIDADES</b>					<b>658,243.17</b>	<b>0.01</b>
<b>TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>						
<b>INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA</b>						
<b>TÍTULOS BANCARIOS</b>						
F	BACOMER	18152	mxA-1+	500,000	50,070,897.00	0.85
F	BACOMER	18164	mxA-1+	500,000	50,247,712.50	0.86
F	BACOMER	18170	mxA-1+	800,000	80,139,131.20	1.37
F	BANAMEX	7441	mxA-1+	2,000,000	201,036,990.00	3.43
F	BANORTE	18023	mxA-1+	550,000	55,025,984.20	0.94
F	BANORTE	18025	mxA-1+	900,000	90,044,530.20	1.54
F	BANORTE	19002	mxA-1+	700,000	70,116,221.00	1.20
F	BANSAN	18034	MX-1	1,100,000	110,266,701.60	1.88
F	BANSAN	18072	MX-1	1,000,000	100,496,589.00	1.72
F	BANSAN	18084	MX-1	1,000,000	100,476,382.00	1.72
F	BSCTIA	19001	mxA-1+	1,200,000	120,215,203.20	2.05
F	HSBCMX	19011	mxA-1+	1,000,000	100,167,191.00	1.71
94	BACOMER	16	Aaa.mx	500,000	50,362,187.00	0.86
<b>PAPEL PRIVADO</b>						
J1	CABEI	1-15	mxAAA	2,000,000	200,372,324.00	3.42
J1	CABEI	2-15	mxAAA	800,000	80,562,960.00	1.38
91	CETEMEM	17-2	mxAAA	500,000	50,173,395.50	0.86
91	DAIMLER	17	mxAAA	568,700	56,962,821.51	0.97
91	DAIMLER	19-2	mxAAA	400,000	40,237,211.60	0.69
91	DHIC	15	AA(mex)	418,000	41,917,808.28	0.72
91	GBM	15	AA(mex)	750,000	75,028,812.00	1.28
91	GBM	16	AA(mex)	500,000	50,090,383.50	0.86
91	GBM	17	AA(mex)	207,583	20,805,582.43	0.36
91	NM	18-2	mxAA+	200,000	20,110,490.20	0.34
91	SORIANA	15	AA+(mex)	200,000	13,459,793.40	0.23
93	DAIMLER	01019	mxA-1+	896,050	89,459,977.89	1.53
<b>TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA</b>					<b>1,917,847,280.21</b>	<b>32.74</b>
<b>TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>					<b>1,917,847,280.21</b>	<b>32.74</b>
<b>OPERACIONES DE REPORTE</b>						
<b>REPORTADO</b>						
LD	BONDESD	230831	mxAAA	6,708,584	668,898,503.24	11.42
2U	CBIC002	300117	mxAAA	3,058,234	2,279,411,521.72	38.91
94	BACOMER	18	Aaa.mx	1,715,699	172,473,129.86	2.94
94	BANORTE	18-2	mxAAA	2,283,303	228,878,554.98	3.91
94	BINBUR	18	mxAAA	668,865	66,997,879.03	1.14
94	BSMX	18	Aaa.mx	1,588,464	159,647,355.00	2.73
95	CFE	10-2	Aa1.mx	596,503	63,261,107.84	1.08
95	CIENCB	15	mxAAA	3,246,459	300,141,125.14	5.12
<b>TOTAL OPERACIONES DE REPORTE</b>					<b>3,939,709,176.81</b>	<b>67.25</b>
<b>TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES</b>					<b>5,858,214,700.19</b>	<b>100.00</b>

### CLASIFICACIÓN CORTO PLAZO

**CALIFICACIÓN**  
AAAf/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