

GBMfondos

GBMGUB GBM FDO DE INSTRUMENTOS GUBERNAMENTALES, 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
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN						
CHD	BANAMEX	3787508		9,984	189,124.90	0.01
TOTAL DISPONIBILIDADES					189,124.90	0.01
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
IM	BPAG28	190725	mxAAA	2,000,000	201,273,834.00	12.27
LD	BONDES	190606	mxAAA	500,000	50,240,990.00	3.06
LD	BONDES	190627	mxAAA	2,000,000	201,285,690.00	12.27
LD	BONDES	190808	mxAAA	2,000,000	200,677,330.00	12.23
LD	BONDES	191024	mxAAA	2,080,691	209,039,211.78	12.74
LD	BONDES	191205	mxAAA	1,000,000	100,138,496.00	6.10
S	UDIBONO	190613	mxAAA	32,284	20,431,600.97	1.25
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					983,087,152.75	59.92
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					983,087,152.75	59.92
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADO						
LD	BONDES	230831	mxAAA	6,593,143	657,388,129.06	40.07
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					657,388,129.06	40.07
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					1,640,664,406.71	100.00

CLASIFICACIÓN DISCRECIONAL EN GUBERNAMENTAL

CALIFICACIÓN
AAA+/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