

GBMfondos

GBMM3 GBM FONDO PARA PERSONAS MORALES EXENTAS, S.A. DE C.V., F.I.I.D.
CARTERA DE VALORES AL 30 ABRIL, 2019

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif / Bursatilidad	Cant. Titulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN						
CHD	BANAMEX	3795519		3,345,230	63,368,025.04	1.80
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA						
BI	CETES	190509	mxAAA	107,923	1,077,524.17	0.03
TOTAL DISPONIBILIDADES					64,445,549.21	1.83
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
BI	CETES	190509	mxAAA	892,077	8,906,669.83	0.25
TÍTULOS BANCARIOS						
F	BACOMER	18152	mxA-1+	500,000	50,070,897.00	1.42
F	BACOMER	18182	mxA-1+	1,000,000	100,661,889.00	2.86
F	BACOMER	18164	mxA-1+	750,000	75,371,568.75	2.14
F	BACOMER	18170	mxA-1+	600,000	60,104,348.40	1.71
F	BANAMEX	7441	mxA-1+	2,000,000	201,036,990.00	5.72
F	BANORTE	18023	mxA-1+	550,000	55,025,984.20	1.57
F	BANORTE	19025	mxA-1+	900,000	90,044,530.20	2.56
F	BANORTE	19012	mxA-1+	900,000	90,170,794.80	2.57
F	BANSAN	18034	MX-1	1,000,000	100,242,456.00	2.85
F	BANSAN	18059	MX-1	500,000	50,072,050.00	1.42
F	BANSAN	18072	MX-1	500,000	50,248,294.50	1.43
F	BSCCTIA	19016	mxA-1+	1,000,000	100,160,366.00	2.85
F	HSBCMX	18010	mxA-1+	1,000,000	100,477,131.00	2.86
F	HSBCMX	19009	mxA-1+	1,500,000	150,214,681.50	4.27
F	HSBCMX	19011	mxA-1+	250,000	25,041,797.75	0.71
94	BANORTE	18	mxAAA	274,500	27,561,186.03	0.78
PAPEL PRIVADO						
AIM	GBM	0777687		2,504,800	2,505,961.00	0.07
AIM	PGOLDMA	0103194		5,319,124	5,319,124.00	15.05
D2	CONM151	151215	mxAAA	1,000	12,781,719.66	0.36
EAIM	FCSTONE	0002781		189,426	189,426.00	0.01
EAIM	PGOLDMA	0103194		20,247,422	20,247,422.00	0.58
JE	AMX	0619	mxAAA	5,000	51,044,663.29	1.45
90	PAMMBCB	14U	mxAAA	56,139	33,054,804.15	0.94
91	ARA	17	mxA+	400,000	40,714,000.80	1.16
91	CETELM	17	mxAAA	545,480	54,721,039.89	1.56
91	CETELM	17-2	mxAAA	350,000	35,121,376.85	1.00
91	DAIMLER	18-3	mxAAA	364,129	36,472,332.04	1.04
91	DAIMLER	18-3	mxAAA	500,000	50,309,728.50	1.43
91	DAIMLER	19-2	mxAAA	200,000	20,118,605.80	0.57
91	DHIC	15	AA(mex)	380,000	38,107,098.44	1.08
91	FMCARCB	19	mxAA	100,000	10,046,150.70	0.29
91	GAP	15	mxAAA	843,038	84,779,765.77	2.41
91	HOLCIM	15	mxAAA	754,331	75,832,281.40	2.16
91	MONTPIO	14	HR AA	450,000	15,092,604.90	0.43
91	NM	18-2	mxAA+	500,000	50,278,225.50	1.43
91	SCRECB	16	mxAAA	54,160	5,452,706.45	0.16
91	SIPYTCB	13	mxA	75,989	6,186,249.14	0.18
91	SORIANA	15	AA(mex)	450,000	30,284,535.15	0.86
91	TLVEISA	14	As1.mx	350,000	35,042,093.45	1.00
91	TOYOTA	14	mxAAA	400,000	20,107,945.60	0.57
91	VWLEASE	15	mxAAA	346,000	34,650,691.42	0.99
91	VWLEASE	17-2	mxAAA	217,726	21,852,523.08	0.62
91	VWLEASE	18-2	mxAAA	220,000	22,158,596.22	0.63
91	ZONALCB	06U	AA(mex)	13,754	3,793,287.41	0.11
91	ZONALCB	06-2U	A(mex)	4,256	1,810,360.39	0.05
91	ZONALCB	06-3U		4,573	2,233,165.59	0.06
95	CDVITOT	14U	Asia.mx	126,994	29,755,321.42	0.85
95	CEREBVIS	10-6U	mxAAA	35,986	3,320,259.14	0.09
95	CFE	15	As1.mx	264,199	26,512,074.80	0.75
95	FEFA	17-7	mxAAA	800,000	80,073,628.80	2.28
95	FEFA	18	mxAAA	359,025	36,039,108.29	1.03
95	FNCOOT	18	AAA(mex)	278,797	27,951,340.71	0.80
95	IFCOTCB	17	AAA(mex)	500,000	50,484,763.50	1.44
95	PEMEX	16	As3.mx	1,081,000	108,999,235.26	3.10
95	TFOVICB	13-3U	mxAAA	211,181	53,745,564.36	1.53
95	TFOVIS	11-3U	mxAAA	32,304	2,890,269.72	0.08
95	TFOVIS	13-2U	mxAAA	100,000	19,545,018.60	0.56
95	TFOVIS	14U	Aaa.mx	96,970	32,877,057.50	0.94
95	TFOVIS	14-2U	mxAAA	39,493	14,304,612.10	0.41
97	BRHDCB	08U	Ba3.mx	72,393	1.38	0.00
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					2,642,230,368.33	75.18
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					2,642,230,368.33	75.18
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADO						
91	CETELM	18-2	mxAAA	494,678	50,023,521.65	1.42
91	VWLEASE	02319	mxA-1+	501,033	50,023,522.79	1.42
93	VWLEASE	02519	mxA-1+	802,966	80,037,576.58	2.28
94	BACOMER	18	Asia.mx	1,309,745	131,664,015.35	3.75
94	BANORTE	18-2	mxAAA	1,743,947	174,723,231.48	4.97
94	BINBUR	18	mxAAA	510,604	51,145,425.50	1.46
94	BSMX	18	Asia.mx	1,212,615	121,872,939.76	3.47
95	CFE	10-2	As1.mx	455,364	48,292,852.02	1.37
95	CFE	17	mxAAA	1,083,055	100,046,968.35	2.85
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					807,830,053.48	22.99
OPERACIONES CON DERIVADOS						
FUTUROS						
FB	DC24	JN19		310	-23,250.00	0.00
FB	DC24	JN19		310	-23,250.00	0.00
FCSP	PE	M9		174	313,128.30	0.01
FCSP	US	M9		2	-18,942.80	0.00
FCSP	US	M9		2	-18,942.80	0.00
FCSP	US	M9		1	-9,471.40	0.00
FCSP	US	M9		2	-18,942.80	0.00
FCSP	US	M9		4	-37,885.60	0.00
FCSP	US	M9		1	-9,471.40	0.00
OPCIONES						
OCSP	USM9	C14800		5	-57,716.35	0.00
TOTAL OPERACIONES CON DERIVADOS					95,255.15	0.00
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					3,514,601,226.17	100.00

CLASIFICACIÓN DISCRECIONAL

CLASIFICACIÓN
AA1/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 los 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