GBMfondos

GBMF3 GBM VALORES DE DEUDA, S.A. DE C.V., F.I.I.D.
CARTERA DE VALORES AL 07 NOVIEMBRE, 2019

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Titulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN						
CHD	BANAMEX	3811506		2,367,298	45,284,035.81	1.11
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA						
AIM	GBM	0777641		4,384,800	4,385,751.00	0.11
AIM	PGOLDMA	0103193		13,197,235	13,197,235.00	0.32
BI	CETES	191205	mxAAA	189,652	1,885,787.21	0.05
EAIM	FCSTONE	0002779		191,164	191,164.00	0.00
EAIM	PGOLDMA	0103193		26,807,695	26,807,695.00	0.66
TOTAL DISPONIBILIDADES					**91,751,668.02**	**2.25**
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1C	CORPTRC	ISHRS	BAJA	1,558,516	13,621,429.84	0.33
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					**13,621,429.84**	**0.33**
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
BI	CETES	191205	mxAAA	810,348	8,057,620.79	0.20
D1SP	UMS19F	2019F	BBB	7,124	141,007,675.14	3.47
D1SP	UMS22F	2022F	BBB	2,534	57,373,854.36	1.41
TÍTULOS BANCARIOS						
CD	BACMEXT	17	Aaa.mx	500,000	50,291,397.00	1.24
CD	BANOB	17X	mxAAA	1,528,607	153,301,622.10	3.77
F	BACOMER	19194	mxA-1+	600,000	60,013,485.60	1.47
F	BANORTE	19008	mxA-1+	400,000	40,082,109.60	0.99
F	BANORTE	19012	mxA-1+	500,000	50,025,188.00	1.23
F	BANSAN	19013	MX-1	1,250,000	125,481,516.25	3.08
F	BANSAN	19023	MX-1	750,000	75,254,556.00	1.85
F	BSCTIA	19016	mxA-1+	600,000	60,387,301.20	1.48
F	BSCTIA	19024	mxA-1+	300,000	30,030,336.90	0.74
F	BSCTIA	19025	mxA-1+	500,000	50,321,116.00	1.24
F	BSCTIA	19027	mxA-1+	125,000	12,539,655.88	0.31
F	BSCTIA	19039	mxA-1+	1,000,000	100,031,251.00	2.46
F	HSBCMX	19011	mxA-1+	300,000	30,009,021.30	0.74
F	HSBCMX	19024	mxA-1+	500,000	50,045,578.50	1.23
F	HSBCMX	19029	mxA-1+	500,000	50,014,922.00	1.23
94	BLADEX	19	mxAAA	350,000	35,264,556.95	0.87
94	HSBC	19	Aaa.mx	250,000	25,250,815.75	0.62
94	HSBC	19-2	Aaa.mx	1,000,000	100,832,797.00	2.48
94	SCOTIAB	15-2	mxAAA	430,000	43,285,193.20	1.06
PAPEL PRIVADO						
D2	CONM151	351215	mxAAA	1,000	13,602,651.73	0.33
D2	C743	201104	F1	600,000	60,013,874.40	1.47
JI	CABEI	1-10	mxAAA	755,033	76,355,474.04	1.88
JI	CABEI	1-17	mxAAA	797,601	80,254,143.63	1.97
JI	CABEI	1-18	mxAAA	70,500	7,105,545.12	0.17
JI	CABEI	1-19	mxAAA	1,500,000	151,268,085.00	3.72
JI	CABEI	2-15	mxAAA	1,111,875	111,656,503.33	2.74
90	PAMMCB	14U	mxAAA	79,238	47,706,187.17	1.17
91	ARA	17	mxA+	450,000	45,670,795.65	1.12
91	ATLASCB	19	HR AAA	200,000	20,077,681.40	0.49
91	CETELEM	17-2	mxAAA	839,000	84,601,650.67	2.08
91	DAIMLER	18-3	mxAAA	500,000	50,244,591.50	1.23
91	DAIMLER	19-2	mxAAA	500,000	50,254,924.50	1.24
91	DANHOS	16-2	AAA(mex)	39,655	3,976,670.54	0.10
91	DHIC	15	AA(mex)	395,733	39,648,243.92	0.97
91	FMCARCB	19	mxAA	100,000	10,065,103.90	0.25
91	GAP	16	mxAAA	500,000	50,344,582.50	1.24
91	GBM	16	AA(mex)	815,448	81,599,661.71	2.01
91	GBM	19	AA(mex)	1,020,000	102,536,526.12	2.52
91	GMXT	17-2	mxAAA	58,380	5,867,086.38	0.14
91	HOLCIM	15	mxAAA	1,238,363	124,260,070.30	3.05
91	LALA	18-3	AA(mex)	332,500	33,360,607.79	0.82
91	MONTPIO	17	HR AA	197,000	19,862,785.04	0.49
91	NM	18-2	mxAA+	600,000	60,226,175.40	1.48
91	OSM	15-2	mxAA-	340,084	34,139,338.12	0.84
91	SIPYTCB	13	mxA	80,526	6,778,253.91	0.17
91	SORIANA	15	HR AA	1,680,489	112,828,586.02	2.77
91	VWLEASE	17	mxAAA	197,000	19,831,599.55	0.49
91	VWLEASE	18-2	mxAAA	250,000	25,135,269.00	0.62
95	CEDEVIS	10-6U	mxAAA	59,994	3,902,026.02	0.10
95	CFE	14	Aa1.mx	1,827,955	182,921,848.25	4.50
95	CFE	15	Aa1.mx	300,000	30,092,960.10	0.74
95	FEFA	17-2	mxAAA	720,000	72,190,349.28	1.77
95	FEFA	17-4	mxAAA	242,702	24,429,690.16	0.60
95	FEFA	17-7	mxAAA	106,830	10,758,462.68	0.26
95	FEFA	17-8	mxAAA	1,288,000	130,006,034.26	3.20
95	FEFA	18-3	mxAAA	200,000	20,082,065.20	0.49
95	PEMEX	10-2	Aa3.mx	500,000	51,309,126.50	1.26
95	TFOVICB	13-3U	mxAAA	133,904	31,524,421.91	0.77
95	TFOVIS	14-2U	mxAAA	55,475	19,396,465.56	0.48
97	BRHCCB	08U	Ba3.mx	144,300	2.74	0.00
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					**3,454,787,691.52**	**84.90**
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					**3,468,409,121.36**	**85.24**
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADO						
LD	BONDESD	210915	mxAAA	427,695	42,786,102.58	1.05
2U	CBIC002	300117	mxAAA	533,846	425,080,223.30	10.45
95	CFE	14-2	Aa1.mx	411,059	40,008,750.71	0.98
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					**507,875,076.59**	**12.48**
OPERACIONES CON DERIVADOS						
FUTUROS						
FB	DC24	DC19		450	157,500.00	0.00
FB	DC24	DC19		630	220,500.00	0.01
FCSP	PE	Z9		16	19,899.19	0.00
FCSP	PE	Z9		537	667,866.71	0.02
TOTAL OPERACIONES CON DERIVADOS					**1,065,765.90**	**0.03**
TOTAL DE INVERSION EN VALORES					**4,069,101,631.87**	**100.00**

CATEGORÍA
DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN
AAf/S4(mex)

VaR Promedio
0.011%

Límite de VaR
0.480%

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. Raymundo Leal Vargas