

gbmfondos

GBMUSD GBM FONDO DE INVERSION EN VALORES DENOMINADOS EN DOLARES, S.A. DE C.V., F.I.R.V. CARTERA DE VALORES AL 31 OCTUBRE, 2019

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN						
CHD	BANAMEX	2528508		3,414,560	65,687,600.75	5.85
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA						
AIM	PGOLDMA	0103191		467,866	467,866.00	0.04
EAIM	FCSTONE	0002780		192,369	192,369.00	0.02
EAIM	PGOLDMA	0103191		2,670,806	2,670,806.00	0.24
TOTAL DISPONIBILIDADES					69,018,641.75	6.15
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1ISP	FLOT	*	NA	86,025	84,383,653.75	7.51
1ISP	VCSH	*	NA	33,785	52,820,537.45	4.70
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					137,204,191.20	12.22
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
D1SP	UMS19F	2019F	BBB	11,076	220,457,375.93	19.63
D1SP	UMS22F	2022F	BBB	10,142	229,879,079.10	20.47
D1SP	UMS26F	2026F	BBB	2,394	70,211,478.86	6.25
TÍTULOS BANCARIOS						
D2SP	BACRD76	191108	Baa3	2,725	53,120,006.92	4.73
D2SP	BINBL53	240606	BBB	1,350	27,296,382.56	2.43
D2SP	BSMXG23	281001	Baa3	700	14,583,667.76	1.30
D2SP	NAFIA24	201105	BBB	3,500	68,956,740.84	6.14
D2SP	SANTD70	230223	Baa1	8	31,179,873.50	2.78
D8SP	BBVA2	1-18	BBB-	2,337	47,585,184.41	4.24
PAPEL PRIVADO						
D2SP	BACRJ12	210111	A	1,000	19,549,524.02	1.74
D2SP	BBVAA49	220420	BB	500	9,848,950.73	0.88
D2SP	BIMBG97	300620	Baa2	255	5,064,216.57	0.45
D2SP	BINBM37	270411	BBB	500	9,941,779.69	0.89
D2SP	CYDSA81	271004	BB	902	18,048,830.07	1.61
D2SP	FUNOA69	241215	Baa2	250	5,254,644.65	0.47
D2SP	GCCAB00	240623	BB+	2,000	40,796,964.95	3.63
D2SP	KUOBF33	270707	BB	750	15,113,969.29	1.35
D2SP	MXCHB45	061119	Baa3	200	4,031,005.45	0.36
D2SP	SIGMB54	161219	Baa3	1,100	21,815,476.50	1.94
D2SP	TERRA76	221110	Baa3	200	4,139,669.53	0.37
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					916,874,821.33	81.64
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					1,054,079,012.53	93.85
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADO						
LD	BONDESD	230706	mxAAA	183	18,207.38	0.00
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					18,207.38	0.00
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					1,123,115,861.66	100.00

CATEGORÍA DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
0.949%

Límite de VaR
3.400%

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