

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 DICIEMBRE, 2019

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN						
CHD	BANAMEX	2528508		15,832,911	299,360,770.33	28.21
TOTAL DISPONIBILIDADES					299,360,770.33	28.21
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1ISP	FLOT	*	NA	86,025	82,822,280.65	7.81
1ISP	VCSH	*	NA	33,785	51,761,144.58	4.88
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					134,583,425.23	12.68
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
D1SP	UMS22F	2022F	BBB	10,282	231,981,451.44	21.86
D1SP	UMS26F	2026F	BBB	2,394	67,625,873.84	6.37
TÍTULOS BANCARIOS						
D2SP	BINBL53	240606	BBB	1,350	26,466,133.84	2.49
D2SP	BSMXG23	281001	Baa3	700	14,482,675.99	1.36
D2SP	NAFIA24	201105	BBB	4,193	80,346,938.52	7.57
D2SP	SANTD70	230223	Baa1	8	30,605,740.84	2.88
D8SP	BBVA2	1-18	BBB-	2,337	47,034,877.19	4.43
PAPEL PRIVADO						
D2SP	BACRJ12	210111	A	1,000	19,262,842.83	1.82
D2SP	BBVAA49	220420	BB	500	9,726,340.58	0.92
D2SP	BIMBG97	300620	Baa2	255	4,879,399.55	0.46
D2SP	BINBM37	270411	BBB	500	9,853,815.74	0.93
D2SP	CYDSA81	271004	BB	902	17,821,641.44	1.68
D2SP	FUNOA69	241215	Baa2	250	5,153,672.42	0.49
D2SP	GCCAB00	240623	BB+	2,000	39,396,139.68	3.71
D2SP	KUOBF33	270707	BB	750	15,241,213.63	1.44
D2SP	TERRA76	221110	Baa3	200	4,030,770.18	0.38
EAIM	FCSTONE	0002780		189,069	189,069.00	0.02
EAIM	PGOLDMA	0103191		3,089,879	3,089,879.00	0.29
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					627,188,475.71	59.11
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					761,771,900.94	71.79
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADOR						
LD	BONDESD	210325	mxAAA	103	10,330.16	0.00
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					10,330.16	0.00
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					1,061,143,001.43	100.00

CATEGORÍA DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
0.838%

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. Raymundo Leal Vargas