



GBMDOL GBM FONDO DE INVERSION EN DOLARES, S.A. DE C.V., S.I.I.D.
CARTERA DE VALORES AL 15 junio, 2017

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN						
CHD	BANAMEX	2531509		63,292,237	1,143,962,884.99	39.61
TOTAL DISPONIBILIDADES					1,143,962,884.99	39.61
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
D1SP	UMS19F	2019F	BBB+	20,487	446,369,548.70	15.45
D1SP	UMS22F	2022F	BBB+	5,050	116,247,860.28	4.02
TÍTULOS BANCARIOS						
D2SP	BBVAB20	100321	Baa3	1,500	30,326,416.11	1.05
D2SP	DBD94	190118	BBB-	700	12,852,632.21	0.45
D2SP	DBE79	180213	BBB-	2,300	41,662,741.53	1.44
D2SP	NAFI042	170713	A-2	3,000	54,176,371.45	1.88
D2SP	NAFI094	170918	A-2	2,250	40,509,178.00	1.40
D2SP	NAFI247	171023	A-2	3,500	62,927,620.87	2.18
D2SP	NAFI297	171004	A-2	2,250	40,481,116.30	1.40
D2SP	NAFI449	170906	A-2	1,500	27,020,112.32	0.94
D2SP	NAFI482	170925	A-2	2,250	40,496,996.57	1.40
D2SP	NAFI561	170717	A-2	2,250	40,627,213.31	1.41
D2SP	NAFI593	170724	A-2	3,500	63,183,514.43	2.19
D2SP	NAFI612	170626	A-2	2,250	40,654,482.15	1.41
D2SP	NAFI638	171030	A-2	3,500	62,899,131.07	2.18
D2SP	NAFI645	171016	A-2	2,250	40,461,374.86	1.40
D2SP	NAFI711	170731	A-2	3,500	63,168,133.81	2.19
D2SP	NAFI787	170829	A-2	1,350	24,329,510.06	0.84
D2SP	NAFI854	170629	A-2	2,250	40,650,775.84	1.41
D2SP	NAFI938	170927	A-2	2,250	40,494,574.50	1.40
D2SP	NAFI992	170706	A-2	2,250	40,641,814.51	1.41
PAPEL PRIVADO						
AIM	FCSTONE	0002783		7,747,295	7,747,295.00	0.27
D2SP	ALFAD03	280223	BB+	230	4,396,121.62	0.15
D2SP	CEMEL61	181015	BB-	500	9,507,834.38	0.33
D2SP	CFELJ79	260521	BBB+	4,350	84,362,229.85	2.92
D2SP	KUOE67	041222	BB	2,300	43,465,829.74	1.50
D2SP	NAFI799	170620	A-2	2,250	40,662,186.12	1.41
D2SP	PEMEK76	180718	Baa3	1,700	31,433,295.05	1.09
D2SP	PEMEX3	300318	Baa3	1,082	21,067,588.94	0.73
D2SP	PEMEX4	010318	Baa3	1,500	28,327,963.35	0.98
D2SP	TERRA76	221110	Baa3	2,500	47,117,440.81	1.63
EAIM	FCSTONE	0002783		-262,207	-262,207.00	-0.01
95	PEMEX	16	Aa3.mx	550,000	55,725,650.75	1.93
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					1,743,732,347.49	60.37
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					1,743,732,347.49	60.37
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADO						
LD	BONDESD	200702	mxAAA	2,980	296,538.87	0.01
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					296,538.87	0.01
OPERACIONES CON DERIVADOS						
FUTUROS						
FCSP	PE	U7		112	293,522.92	0.01
TOTAL OPERACIONES CON DERIVADOS					293,522.92	0.01
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					2,888,285,294.27	100.00

CLASIFICACIÓN

DISCRECIONAL ESPECIALIZADA EN INVERSIONES EN DÓLARES

CALIFICACIÓN
AA/6

VaR Promedio
1.485%

Límite de VaR
3.198%

Para llevar a cabo la estimación del Valor en Riesgo (VaR) de mercado para las Sociedades de Inversión administradas 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 Modoro