

GBMfondos

GBMF2 GBM FONDO DE CORTO PLAZO, S.A. DE C.V., F.I.I.D.
CARTERA DE VALORES AL 17 JUNIO, 2021

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN						
CHD	BANAMEX	3938506		1	20.25	0.00
CHD	JPMOR	3128912		35,441	724,998.82	0.01
TOTAL DISPONIBILIDADES					725,019.07	0.01
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
BI	CETES	210729	mxAAA	20,000,000	199,084,320.00	3.50
BI	CETES	210923	mxAAA	64,000,000	633,027,776.00	11.13
BI	CETES	211007	mxAAA	20,000,000	197,487,660.00	3.47
BI	CETES	211118	mxAAA	10,000,000	98,202,350.00	1.73
TÍTULOS BANCARIOS						
F	BANOBRA	21067	mxA-1+	2,500,000	250,115,450.00	4.40
94	BACOMER	18	Aaa.mx	500,000	50,109,185.50	0.88
94	BACOMER	18V	Aaa.mx	200,000	20,041,221.40	0.35
94	BACOMER	19	Aaa.mx	200,000	20,048,082.20	0.35
94	BSMX	19	Aaa.mx	106,027	10,627,647.84	0.19
94	HSBC	19-2	Aaa.mx	300,000	30,099,270.00	0.53
94	SCOTIAB	17-2	mxAAA	550,000	55,335,167.80	0.97
94	SCOTIAB	18	mxAAA	197,958	19,848,058.54	0.35
94	SCOTIAB	19-2	mxAAA	500,000	50,165,343.50	0.88
PAPEL PRIVADO						
JI	CABEI	1-19	mxAAA	1,958,000	197,357,326.63	3.47
91	BBVALMX	18	AAA(mex)	700,000	70,126,852.60	1.23
91	DAIMLER	19-3	mxAAA	184,200	18,428,228.58	0.32
91	DHIC	15	AA+(mex)	418,000	41,964,699.11	0.74
91	GBM	19	AA-(mex)	500,000	50,207,933.00	0.88
91	GBM	21	HR AA+	900,000	90,088,451.10	1.58
91	VWLEASE	18-2	mxAAA	474,000	47,498,792.50	0.84
92	FEFA	02220	mxA-1+	500,000	50,079,485.50	0.88
93	CETEMEM	00321	mxA-1+	244,099	24,434,069.71	0.43
93	CETEMEM	00521	mxA-1+	100,000	10,018,548.60	0.18
93	TOYOTA	00221	mxA-1+	356,585	35,755,348.13	0.63
93	TOYOTA	00321	mxA-1+	120,000	12,020,986.68	0.21
95	CFE	21	mxAAA	530,000	53,164,601.04	0.93
95	FEFA	18-3	mxAAA	100,000	10,048,339.60	0.18
95	FEFA	20-3	mxAAA	800,000	80,242,405.60	1.41
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					2,425,627,601.16	42.64
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					2,425,627,601.16	42.64
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADOR						
IS	BPA182	250306	mxAAA	4,960,283	500,054,801.27	8.79
LD	BONDESD	240530	mxAAA	10,000,000	996,756,055.29	17.52
LD	BONDESD	250220	mxAAA	7,193,565	715,218,297.11	12.57
2U	CBIC002	300117	mxAAA	1,139,594	1,050,088,772.01	18.46
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					3,262,117,925.68	57.35
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					5,688,470,545.91	100.00

CATEGORÍA
CORTO PLAZO

CALIFICACIÓN
AAAf/S2(mex)

VaR Promedio
0.002%

Límite de VaR
0.250%

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

Ing. Fernando Castro Tapia