

gbmfondos

GBMF3 GBM VALORES DE DEUDA, 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	3811506		1	15.98	0.00
CHD	JPMOR	3128888		270,565	5,534,812.92	0.15
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA						
AIM	GBM	0777641		2,622,800	2,623,088.00	0.07
AIM	PGOLDMA	0103193		4,762,273	4,762,273.00	0.13
BI	CETES	210902	mxAAA	124,345	1,232,831.19	0.03
EAIM	FCSTONE	0002779		204,435	204,435.00	0.01
EAIM	PGOLDMA	0103193		7,004,787	7,004,787.00	0.19
TOTAL DISPONIBILIDADES					21,362,243.09	0.58
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS DE SERVICIOS FINANCIEROS						
1C	CORPTRC	ISHRS	BAJA	1,558,516	13,262,971.16	0.36
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					13,262,971.16	0.36
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
BI	CETES	210729	mxAAA	19,112,700	190,251,944.14	5.15
BI	CETES	210902	mxAAA	83,155	824,448.73	0.02
BI	CETES	210923	mxAAA	15,000,000	148,365,885.00	4.01
BI	CETES	211118	mxAAA	22,000,000	216,045,170.00	5.84
D1SP	UMS22F	2022F	BBB-	3,700	84,675,169.36	2.29
M	BONOS	230309	mxAAA	2,200,000	230,388,081.00	6.23
M	BONOS	231207	mxAAA	150,000	15,921,615.00	0.43
M	BONOS	241205	mxAAA	1,150,000	130,145,225.15	3.52
M	BONOS	310529	mxAAA	350,000	37,590,237.30	1.02
TÍTULOS BANCARIOS						
F	BANOBRA	21067	mxA-1+	1,000,000	100,046,180.00	2.71
94	BACOMER	19	Aaa.mx	1,200,000	120,288,493.20	3.25
94	BINBUR	14-7	mxAAA	350,000	36,116,578.75	0.98
94	BLADEX	19	mxAAA	383,679	38,552,260.45	1.04
94	BSMX	18	Aaa.mx	27,100	2,716,320.29	0.07
94	BSMX	19	Aaa.mx	180,000	18,042,353.46	0.49
94	HSBC	19	Aaa.mx	250,000	25,104,002.50	0.68
94	HSBC	19-2	Aaa.mx	1,000,000	100,330,900.00	2.71
94	SCOTIAB	17-3	mxAAA	1,500,000	150,623,758.50	4.07
PAPEL PRIVADO						
D2	CONM151	351215	mxAAA	1,000	15,906,656.74	0.43
JE	AMX	1122	mxAAA	3,000	30,436,467.80	0.82
JI	CABEI	1-19	mxAAA	1,200,000	120,954,439.20	3.27
90	PAMMCB	14U	mxAAA	79,238	48,408,760.72	1.31
91	ARA	17	mxA+	450,000	34,765,183.35	0.94
91	ATLASCB	19	HR AAA	200,000	20,083,933.40	0.54
91	CETELM	18-2	mxAAA	50,000	5,009,929.35	0.14
91	CETELM	19	mxAAA	50,000	5,007,847.10	0.14
91	CETELM	19-3	mxAAA	147,166	14,769,281.60	0.40
91	DAIMLER	19	mxAAA	200,000	21,050,878.60	0.57
91	DAIMLER	19-3	mxAAA	200,000	20,008,934.40	0.54
91	DAIMLER	20-2	mxAAA	150,000	15,595,252.35	0.42
91	DHIC	15	AA+(mex)	395,733	39,729,225.53	1.07
91	FERROMX	07-2	mxAAA	200,000	21,066,880.80	0.57
91	FERROMX	21-2	mxAAA	700,000	70,032,452.70	1.89
91	FMCARCB	19	mxAA	74,000	4,527,106.36	0.12
91	FUNO	17-2	AAA(mex)	250,000	24,992,641.00	0.68
91	GAP	16	mxAAA	820,000	82,154,649.54	2.22
91	GBM	19	AA-(mex)	1,020,000	102,424,183.32	2.77
91	GCARSO	20	AAA(mex)	300,000	30,038,878.20	0.81
91	GMXT	17-2	mxAAA	58,380	5,847,787.17	0.16
91	LALA	18-2	HR AA-	451,600	45,098,746.78	1.22
91	MONTPIO	17	HR AA+	197,000	19,820,857.73	0.54
91	SIPYTCB	13	mxCC	80,526	5,160,198.12	0.14
91	SORIANA	20	AA+(mex)	400,000	40,190,191.60	1.09
91	STORAGE	21-2V	AA-(mex)	210,000	21,033,610.50	0.57
91	TIPMXCB	20-2	AAA(mex)	270,000	27,142,125.03	0.73
91	TOYOTA	17-4	mxAAA	220,529	7,372,690.24	0.20
91	VWLEASE	18	mxAAA	623,000	62,455,231.04	1.69
91	VWLEASE	18-2	mxAAA	250,000	25,052,105.75	0.68
91	VWLEASE	19-2	mxAAA	300,000	30,044,147.40	0.81
93	CHDRAUI	01720	F1+(mex)	500,000	50,065,629.00	1.35
95	CFE	21	mxAAA	370,000	37,114,910.16	1.00
95	FEFA	17-8	mxAAA	1,288,000	129,659,016.14	3.51
95	FEFA	18-3	mxAAA	200,000	20,096,679.20	0.54
95	TFOVICB	13-3U	mxAAA	133,904	23,333,761.28	0.63
95	TFOVIS	14U	Aaa.mx	95,111	26,278,525.02	0.71
95	TFOVIS	14-2U	mxAAA	55,475	16,944,944.60	0.46
95	TFOVIS	14-3U	mxAAA	252,167	68,367,328.67	1.85
97	BRHCCB	08U	Ba3.mx	144,300	3.03	0.00
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					3,034,070,693.35	82.08
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					3,047,333,664.51	82.44
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADOR						
LD	BONDESD	260212	mxAAA	3,310,373	328,426,492.94	8.88
2U	CBIC002	300117	mxAAA	48,237	44,448,401.88	1.20
2U	CBIC004	310116	mxAAA	281,384	255,576,877.24	6.91
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					628,451,772.06	17.00
OPERACIONES CON DERIVADOS						
FUTUROS						
FB	DC24	SP21		830	186,750.00	0.01
FCSP	PE	U1		194	-734,196.95	-0.02
TOTAL OPERACIONES CON DERIVADOS					-547,446.95	-0.01
TOTAL DE INVERSION EN VALORES					3,696,600,232.71	100.00

CATEGORÍA  
DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN  
AAf/S4(mex)

VaR Promedio  
0.034%

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