

GBMfondos

GBMGUB GBM FONDO DE INSTRUMENTOS GUBERNAMENTALES, S.A. DE C.V. Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda CARTERA DE VALORES AL 15 SEPTIEMBRE, 2021

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN						
CHD	BANAMEX	3787508		9,984	198,367.08	0.01
CHD	JPMOR	3128805		6,130	121,793.91	0.01
TOTAL DISPONIBILIDADES					320,160.99	0.02
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
BI	CETES	211104	mxAAA	10,000,000	99,381,310.00	6.26
BI	CETES	211118	mxAAA	14,000,000	138,871,054.00	8.75
BI	CETES	211216	mxAAA	28,500,000	281,608,186.50	17.74
M	BONOS	211209	mxAAA	4,000,000	410,096,308.00	25.84
M	BONOS	220609	mxAAA	750,000	76,995,492.00	4.85
M	BONOS	230309	mxAAA	2,750,000	280,313,605.00	17.66
M	BONOS	241205	mxAAA	800,000	90,918,174.40	5.73
M	BONOS	290531	mxAAA	200,000	22,333,816.20	1.41
M	BONOS	310529	mxAAA	200,000	21,476,447.00	1.35
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					1,421,994,393.10	89.59
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					1,421,994,393.10	89.59
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADOR						
LD	BONDES	241024	mxAAA	1,652,945	164,829,005.10	10.39
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					164,829,005.10	10.39
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					1,587,143,559.19	100.00

CATEGORÍA
DISCRECIONAL EN GUBERNAMENTAL

CALIFICACIÓN
AAAf/S3(mex)

VaR Promedio
0.046%

Límite de VaR
0.260%

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