

# GBMfondos

GBMGUB GBM FONDO DE INSTRUMENTOS GUBERNAMENTALES, S.A. DE C.V. Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda  
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	3787508		9,984	204,237.68	0.01
CHD	JPMOR	3128805		1,000	20,456.50	0.00
TOTAL DISPONIBILIDADES					224,694.18	0.01
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
BI	CETES	210729	mxAAA	20,188,185	200,957,554.14	12.10
BI	CETES	211104	mxAAA	10,000,000	98,379,450.00	5.92
BI	CETES	211118	mxAAA	14,000,000	137,483,290.00	8.28
BI	CETES	211216	mxAAA	10,000,000	97,841,450.00	5.89
M	BONOS	230309	mxAAA	2,350,000	246,096,359.25	14.81
M	BONOS	241205	mxAAA	600,000	67,901,856.60	4.09
M	BONOS	290531	mxAAA	100,000	11,172,370.80	0.67
M	BONOS	310529	mxAAA	200,000	21,480,135.60	1.29
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					881,312,466.39	53.05
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					881,312,466.39	53.05
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADOR						
LD	BONDESD	260212	mxAAA	7,858,535	779,655,673.16	46.93
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					779,655,673.16	46.93
TOTAL DE INVERSION EN VALORES					1,661,192,833.73	100.00

CATEGORÍA  
DISCRECIONAL EN GUBERNAMENTAL

CALIFICACIÓN  
AAAf/S3(mex)

VaR Promedio  
0.039%

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