

GBMfondos

GBMGUBL GBM FONDO GUBERNAMENTAL DE LIQUIDEZ INMEDIATA, 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
TITULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
LD	BONDES	210722	mxAAA	4,000,000	400,948,896.00	8.58
LD	BONDES	210819	mxAAA	6,500,000	651,498,887.00	13.94
LD	BONDES	211118	mxAAA	500,000	50,063,724.00	1.07
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					1,102,511,507.00	23.59
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					1,102,511,507.00	23.59
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADOR						
IS	BPA182	250306	mxAAA	18,452,254	1,860,203,985.73	39.80
LD	BONDES	230330	mxAAA	8,000,637	799,779,808.24	17.11
LD	BONDES	250220	mxAAA	9,167,650	911,491,176.01	19.50
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					3,571,474,969.98	76.41
TOTAL DE INVERSION EN VALORES					4,673,986,476.98	100.00

CATEGORÍA
CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL

CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
AAAf/S1(mex)	0.001%	0.030%

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