

GBMfondos

GBMGUBL GBM FONDO GUBERNAMENTAL DE LIQUIDEZ INMEDIATA, S. A. DE C. V., F.I.I.D. CARTERA DE VALORES AL 15 SEPTIEMBRE, 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	211118	mxAAA	500,000	50,133,930.00	1.37
LD	BONDES	220714	mxAAA	2,000,000	200,041,166.00	5.45
LD	BONDES	220811	mxAAA	2,994,862	299,532,135.19	8.16
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					549,707,231.19	14.97
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					549,707,231.19	14.97
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADOR						
IQ	BPAG91	220825	mxAAA	6,949,292	696,046,732.03	18.95
IQ	BPAG91	230427	mxAAA	4,673,114	469,253,499.01	12.78
LD	BONDES	240201	mxAAA	19,647,093	1,957,314,549.21	53.30
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					3,122,614,780.25	85.03
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					3,672,322,011.44	100.00

CATEGORÍA CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL

CALIFICACIÓN
AAAf/S1(mex)

VaR Promedio
0.000%

Límite de VaR
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