

cbmfondos

GBMM3 GBM FONDO PARA PERSONAS MORALES EXENTAS, 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	3795519		0	4.21	0.00
CHD	JPMOR	3128862		300,854	6,154,419.85	0.15
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA						
AIM	GBM	0777687		1,169,200	1,169,327.00	0.03
AIM	PGOLDMA	0103194		540,052	540,052.00	0.01
BI	CETES	210902	mxAAA	55,431	549,576.30	0.01
EAIM	FCSTONE	0002781		204,588	204,588.00	0.01
EAIM	PGOLDMA	0103194		6,164,777	6,164,777.00	0.15
TOTAL DISPONIBILIDADES					14,782,744.36	0.36
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
BI	CETES	210729	mxAAA	12,000,000	119,450,592.00	2.91
BI	CETES	210902	mxAAA	37,069	367,524.38	0.01
BI	CETES	210923	mxAAA	45,000,000	445,097,655.00	10.85
BI	CETES	211118	mxAAA	54,000,000	530,292,690.00	12.93
M	BONOS	211209	mxAAA	1,000,000	101,536,402.00	2.48
M	BONOS	230309	mxAAA	2,650,000	277,512,915.75	6.77
M	BONOS	231207	mxAAA	350,000	37,150,435.00	0.91
M	BONOS	241205	mxAAA	750,000	84,877,320.75	2.07
M	BONOS	310529	mxAAA	250,000	26,850,169.50	0.65
TÍTULOS BANCARIOS						
94	BACOMER	18V	Aaa.mx	709,836	71,129,902.17	1.73
94	BACOMER	20	Aaa.mx	329,590	32,956,224.19	0.80
94	BINBUR	14-7	mxAAA	387,283	39,963,819.91	0.97
94	BINBUR	18	mxAAA	500,000	50,315,399.00	1.23
94	BLADDEX	19	mxAAA	701,909	70,528,172.19	1.72
94	HSBC	19	Aaa.mx	272,687	27,382,140.52	0.67
94	HSBC	19-2	Aaa.mx	750,000	75,248,175.00	1.83
94	SCOTIAB	17-3	mxAAA	519,954	52,211,617.15	1.27
94	SCOTIAB	19-2	mxAAA	1,000,000	100,330,687.00	2.45
PAPEL PRIVADO						
D2	CONM151	351215	mxAAA	1,000	15,906,656.74	0.39
D8	SANTAN	1-07	A	12	11,782,530.57	0.29
JE	AMX	1122	mxAAA	2,200	22,320,076.39	0.54
JI	CAF	11U	mxAAA	6,745	4,657,639.45	0.11
90	PAMMCB	14U	mxAAA	56,139	34,296,920.90	0.84
91	ARA	17	mxA+	400,000	30,902,385.20	0.75
91	ATLASCB	19	HR AAA	200,000	20,083,933.40	0.49
91	BBVALMX	18	AAA(mex)	313,230	31,379,762.91	0.77
91	DAIMLER	18-4	mxAAA	162,000	16,708,384.67	0.41
91	DAIMLER	19	mxAAA	144,563	15,215,890.82	0.37
91	DAIMLER	19-3	mxAAA	339,982	34,013,387.68	0.83
91	DAIMLER	20-2	mxAAA	100,000	10,396,834.90	0.25
91	DHIC	15	AA+(mex)	380,000	38,149,726.46	0.93
91	FERROMX	07-2	mxAAA	200,000	21,066,880.80	0.51
91	FERROMX	21-2	mxAAA	700,000	70,032,452.70	1.71
91	FMCARCB	19	mxAA	60,000	3,670,626.78	0.09
91	FUNO	17-2	AAA(mex)	260,000	25,992,346.64	0.63
91	GAP	16	mxAAA	500,000	50,094,298.50	1.22
91	GAP	20	mxAAA	25,640	2,531,573.60	0.06
91	GBM	21	HR AA+	800,000	80,078,623.20	1.95
91	GCARSO	20	AAA(mex)	200,000	20,025,918.80	0.49
91	INCARSO	17	AA+(mex)	850,310	42,588,005.93	1.04
91	LALA	18-2	HR AA-	359,176	35,868,882.80	0.87
91	SIPYTCB	13	mxCC	75,989	4,869,461.98	0.12
91	SORIANA	20	AA+(mex)	450,000	45,213,965.55	1.10
91	STORAGE	21-2V	AA-(mex)	220,000	22,035,211.00	0.54
91	TIPMXCB	20-2	AAA(mex)	230,000	23,121,069.47	0.56
91	TOYOTA	17-4	mxAAA	405,827	13,567,543.33	0.33
91	VWLEASE	18	mxAAA	100,000	10,024,916.70	0.24
91	VWLEASE	18-2	mxAAA	425,000	42,588,579.78	1.04
91	VWLEASE	19-2	mxAAA	448,847	44,950,751.43	1.10
91	ZONALCB	06U	AA(mex)	14,832	3,994,105.42	0.10
91	ZONALCB	06-2U	A(mex)	4,256	2,089,063.23	0.05
91	ZONALCB	06-3U	AA(mex)	4,207	2,958,096.50	0.07
93	CETEM	00121	mxA- 1+	300,000	30,082,757.40	0.73
93	CETEM	00521	mxA- 1+	172,235	17,255,447.18	0.42
93	CETEM	00621	mxA- 1+	92,600	9,277,330.09	0.23
93	CHDRAUI	01720	F1+(mex)	500,000	50,065,629.00	1.22
95	CDVITOT	14U	Aaa.mx	126,994	22,266,612.75	0.54
95	CFE	21	mxAAA	400,000	40,124,227.20	0.98
95	FEFA	18V	mxAAA	507,000	50,817,920.09	1.24
95	FEFA	18-3	mxAAA	200,000	20,096,679.20	0.49
95	FEFA	19-2	mxAAA	300,000	30,131,923.80	0.73
95	TFOVICB	13-3U	mxAAA	211,181	36,799,849.46	0.90
95	TFOVIS	14U	Aaa.mx	96,970	26,792,154.13	0.65
95	TFOVIS	14-2U	mxAAA	39,493	12,063,212.20	0.29
97	BRHCCB	08U	Ba3.mx	72,393	1.52	0.00
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					3,342,152,089.76	81.49
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					3,342,152,089.76	81.49
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADOR						
LD	BONDESD	260212	mxAAA	7,500,969	744,181,076.37	18.15
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					744,181,076.37	18.15
OPERACIONES CON DERIVADOS						
FUTUROS						
FB	DC24	SP21		370	83,250.00	0.00
FCSP	PE	U1		22	-83,259.45	0.00
TOTAL OPERACIONES CON DERIVADOS					-9.45	0.00
TOTAL DE INVERSION EN VALORES					4,101,115,901.04	100.00

CATEGORÍA  
DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN  
AAf/S4(mex)

VaR Promedio  
0.028%

Límite de VaR  
0.510%

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