

GBMfondos

GBMM3 GBM FONDO PARA PERSONAS MORALES EXENTAS, 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
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN						
CHD	BANAMEX	3795519		0	4.09	0.00
CHD	JPMOR	3128862		300,888	5,978,193.23	0.16
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA						
AIM	GBM	0777687		1,150,700	1,150,988.00	0.03
AIM	PGOLDMA	0103194		524,528	524,528.00	0.01
BI	CETES	211118	mxAAA	54,538	540,982.11	0.01
EAIM	FCSTONE	0002781		198,708	198,708.00	0.01
EAIM	PGOLDMA	0103194		6,237,029	6,237,029.00	0.16
TOTAL DISPONIBILIDADES					14,630,432.43	0.39
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
BI	CETES	210923	mxAAA	5,000,000	49,961,925.00	1.32
BI	CETES	211118	mxAAA	53,945,462	535,104,511.89	14.11
BI	CETES	211216	mxAAA	15,000,000	148,214,835.00	3.91
BI	CETES	220210	mxAAA	5,000,000	48,997,650.00	1.29
M	BONOS	211209	mxAAA	1,000,000	102,524,077.00	2.70
M	BONOS	220609	mxAAA	550,000	56,463,360.80	1.49
M	BONOS	230309	mxAAA	3,300,000	336,376,326.00	8.87
M	BONOS	231207	mxAAA	350,000	37,339,074.50	0.98
M	BONOS	241205	mxAAA	850,000	96,600,560.30	2.55
M	BONOS	310529	mxAAA	350,000	37,583,782.25	0.99
TÍTULOS BANCARIOS						
94	BACOMER	17-2	Aaa.mx	180,000	18,046,743.12	0.48
94	BACOMER	18V	Aaa.mx	709,836	71,195,020.39	1.88
94	BACOMER	19	Aaa.mx	335,357	33,557,214.49	0.89
94	BACOMER	20	Aaa.mx	329,590	33,033,346.28	0.87
94	BINBUR	14-7	mxAAA	387,283	38,898,734.34	1.03
94	BINBUR	18	mxAAA	500,000	50,170,138.50	1.32
94	BLADEX	19	mxAAA	701,909	70,631,858.19	1.86
94	HSBC	19-2	Aaa.mx	750,000	75,325,913.25	1.99
94	SCOTIAB	19-2	mxAAA	1,000,000	100,171,025.00	2.64
PAPEL PRIVADO						
D2	CONM151	351215	mxAAA	88	1,398,935.47	0.04
D8	SANTAN	1-07	A	12	11,834,279.61	0.31
JE	AMX	1122	mxAAA	6,200	63,489,784.41	1.67
JI	CAF	11U	mxAAA	6,745	4,740,876.68	0.13
90	PAMMCB	14U	mxAAA	56,139	34,414,355.27	0.91
91	ARA	17	mxA+	400,000	24,618,012.40	0.65
91	ATLASCB	19	HR AAA	200,000	20,085,767.00	0.53
91	BWMX	21X	AA(mex)	242,155	24,286,615.11	0.64
91	CETEMEM	21	mxAAA	577,345	57,923,075.89	1.53
91	DAIMLER	18-4	mxAAA	162,000	16,925,868.54	0.45
91	DAIMLER	19	mxAAA	144,563	14,717,457.54	0.39
91	DAIMLER	19-3	mxAAA	339,982	33,945,269.56	0.90
91	DAIMLER	20-2	mxAAA	100,000	10,117,072.80	0.27
91	DHIC	15	AA+(mex)	280,000	28,154,661.64	0.74
91	FERROMX	07-2	mxAAA	200,000	21,272,075.80	0.56
91	FERROMX	21-2	mxAAA	700,000	70,101,441.20	1.85
91	FUNO	17-2	AAA(mex)	260,000	25,932,736.70	0.68
91	GAP	17-2	mxAAA	130,000	13,012,845.69	0.34
91	GAP	20	mxAAA	25,640	2,548,739.05	0.07
91	GAP	20-2	mxAAA	100,000	10,112,359.00	0.27
91	GAP	21	mxAAA	200,000	20,149,193.40	0.53
91	GBM	21	HR AA+	800,000	80,167,521.60	2.11
91	GCARSO	20	AAA(mex)	200,000	20,050,152.00	0.53
91	INCARSO	17	AA+(mex)	850,310	42,622,661.17	1.12
91	LALA	18-2	HR AA-	366,977	36,713,769.56	0.97
91	SIPYTCB	13	mxD	75,989	3,986,842.37	0.11
91	SORIANA	20	AA+(mex)	450,000	45,265,297.05	1.19
91	STORAGE	21-2V	AA-(mex)	220,000	22,064,902.20	0.58
91	TIPMXCB	20-2	AAA(mex)	330,000	33,288,988.59	0.88
91	TOYOTA	17-4	mxAAA	405,827	13,583,798.33	0.36
91	VWLEASE	18	mxAAA	100,000	10,038,759.70	0.26
91	VWLEASE	18-2	mxAAA	425,000	42,632,608.08	1.12
91	VWLEASE	19-2	mxAAA	448,847	45,081,300.82	1.19
91	VWLEASE	21	mxAAA	200,000	20,095,133.00	0.53
91	ZONALCB	06U	AA(mex)	14,832	3,999,686.10	0.11
91	ZONALCB	06-2U	A(mex)	4,256	2,102,664.65	0.06
91	ZONALCB	06-3U	AA(mex)	4,207	2,968,286.55	0.08
93	CETEMEM	00521	mxA-1+	172,235	17,275,527.37	0.46
93	CETEMEM	00621	mxA-1+	92,600	9,288,120.77	0.25
93	CHDRAUI	01720	F1+(mex)	500,000	50,112,478.50	1.32
93	NAVISTS	01621	HR+1	400,000	40,009,942.40	1.06
93	TOYOTA	00921	mxA-1+	200,000	20,059,524.80	0.53
95	CDVITOT	14U	Aaa.mx	126,994	19,170,191.70	0.51
95	CFE	21	mxAAA	400,000	40,195,425.20	1.06
95	FEFA	18V	mxAAA	507,000	50,869,459.17	1.34
95	FEFA	18-3	mxAAA	200,000	20,112,030.00	0.53
95	FEFA	19V	mxAAA	300,000	30,098,391.90	0.79
95	FEFA	19-2	mxAAA	300,000	30,052,341.60	0.79
95	TFOVICB	13-3U	mxAAA	211,181	34,463,433.26	0.91
95	TFOVIS	14U	Aaa.mx	96,970	25,526,223.28	0.67
95	TFOVIS	14-2U	mxAAA	39,493	11,553,653.49	0.30
97	BRHCCB	08U	Ba3.mx	72,393	1.52	0.00
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					3,273,426,635.79	86.33
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					3,273,426,635.79	86.33
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADOR						
LD	BONDESD	241219	mxAAA	5,051,017	503,522,399.14	13.28
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					503,522,399.14	13.28
OPERACIONES CON DERIVADOS						
FUTUROS						
FB	DC24	DC21		370	0.00	0.00
FCSP	PE	Z1		22	28,414.54	0.00
TOTAL OPERACIONES CON DERIVADOS					28,414.54	0.00
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					3,791,607,881.90	100.00

CATEGORIA
DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN
AA/S4(mex)

VaR Promedio
0.032%

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