

GBMfondos

GBMPAT GBM FONDO PATRIMONIAL, 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	3788504		1	14.91	0.00
CHD	JPMOR	3128821		2,430,532	49,720,177.86	0.82
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA						
AIM	GBM	0778088		4,266,000	4,266,468.00	0.07
AIM	PGOLDMA	0103190		19,073,641	19,073,641.00	0.32
BI	CETES	210902	mxAAA	202,247	2,005,198.51	0.03
EAIM	FCSTONE	0002784		204,564	204,564.00	0.00
EAIM	PGOLDMA	0103190		18,503,108	18,503,108.00	0.31
TOTAL DISPONIBILIDADES					93,773,172.28	1.55
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
BI	CETES	210902	mxAAA	135,253	1,340,979.66	0.02
BI	CETES	210923	mxAAA	46,000,000	454,968,714.00	7.51
BI	CETES	211021	mxAAA	15,500,000	152,774,711.50	2.52
BI	CETES	211118	mxAAA	40,000,000	392,809,400.00	6.49
BI	CETES	220113	mxAAA	10,000,000	97,493,650.00	1.61
D1SP	UMS22F	2022F	BBB-	10,945	250,478,305.03	4.14
D1SP	UMS26F	2026F	BBB-	500	15,188,477.34	0.25
D1SP	UMS31F	2031F	BBB-	1,000	31,001,996.23	0.51
M	BONOS	230309	mxAAA	4,000,000	418,887,420.00	6.92
M	BONOS	231207	mxAAA	1,000,000	106,144,100.00	1.75
M	BONOS	241205	mxAAA	1,400,000	158,437,665.40	2.62
M	BONOS	290531	mxAAA	50,000	5,586,185.40	0.09
M	BONOS	471107	mxAAA	300,000	32,173,720.50	0.53
TÍTULOS BANCARIOS						
94	BACOMER	17-2	Aaa.mx	1,040,000	104,565,159.92	1.73
94	BACOMER	19	Aaa.mx	1,070,906	107,348,057.58	1.77
94	BINBUR	14-7	mxAAA	950,000	98,030,713.75	1.62
94	BINBUR	18	mxAAA	570,700	57,429,996.42	0.95
94	BLADEX	19	mxAAA	752,317	75,593,193.58	1.25
94	BSMX	18	Aaa.mx	175,000	17,540,813.68	0.29
94	HSBC	13-2	Aaa.mx	750,000	78,317,136.75	1.29
94	HSBC	19	Aaa.mx	250,000	25,104,002.50	0.41
94	HSBC	19-2	Aaa.mx	1,000,000	100,330,900.00	1.66
94	SCOTIAB	17-2	mxAAA	200,000	20,121,879.20	0.33
94	SCOTIAB	17-3	mxAAA	1,850,000	185,769,302.15	3.07
94	SCOTIAB	19-2	mxAAA	1,500,000	150,496,030.50	2.49
PAPEL PRIVADO						
D2	CONM151	351215	mxAAA	1,650	26,245,983.62	0.43
D2	REDC933	280610	BBB	3,000	27,594,547.77	0.46
D2SP	GCCAB00	240623	BBB-	2,000	43,112,926.10	0.71
JE	AMX	1122	mxAAA	7,656	77,673,865.82	1.28
JI	CABEI	1-19	mxAAA	2,050,000	206,630,500.30	3.41
90	PAMMCB	14U	mxAAA	98,724	60,313,315.50	1.00
91	AC	11-2	mxAAA	331,785	33,926,374.25	0.56
91	ATLASCB	19	HR AAA	100,000	10,041,966.70	0.17
91	BACHOCO	17	AAA(mex)	15,000	1,505,536.16	0.02
91	CETILEM	18-2	mxAAA	50,000	5,009,929.35	0.08
91	DAIMLER	18-4	mxAAA	661,092	68,183,823.71	1.13
91	DAIMLER	19	mxAAA	288,836	30,401,257.86	0.50
91	DAIMLER	20-2	mxAAA	250,000	25,992,087.25	0.43
91	DHIC	15	AA+(mex)	300,000	30,118,205.10	0.50
91	FERROMX	07-2	mxAAA	900,000	94,800,963.60	1.57
91	FERROMX	21-2	mxAAA	600,000	60,027,816.60	0.99
91	FMCARCB	19	mxAA	100,000	6,117,711.30	0.10
91	FUNO	17-2	AAA(mex)	280,000	27,991,757.92	0.46
91	GAP	16	mxAAA	95,712	9,589,251.00	0.16
91	GAP	17-2	mxAAA	739,472	73,797,723.87	1.22
91	GBM	19	AA-(mex)	1,000,000	100,415,866.00	1.66
91	GBM	21	HR AA+	650,000	65,063,881.35	1.07
91	GCARSO	20	AAA(mex)	500,000	50,064,797.00	0.83
91	GMXT	17-2	mxAAA	199,060	19,939,371.61	0.33
91	GRUMA	18	mxAA+	298,893	29,959,605.01	0.49
91	LALA	18-2	HR AA-	904,810	90,358,275.19	1.49
91	MONTPIO	17	HR AA+	300,000	30,184,047.30	0.50
91	OSM	15	mxAA-	100,000	10,181,811.70	0.17
91	RCO	12	mxAAA	8,802	714,011.86	0.01
91	SCRECB	16-2	mxAA	200,000	6,222,704.80	0.10
91	SIPYTCB	13	mxCC	76,782	4,920,278.32	0.08
91	SORIANA	20	AA+(mex)	950,000	95,451,705.05	1.58
91	STORAGE	21-2V	AA-(mex)	340,000	34,054,417.00	0.56
91	TIPMXCB	20	AAA(mex)	610,500	58,281,364.80	0.96
91	TOYOTA	17-3	mxAAA	133,000	13,769,498.11	0.23
91	TOYOTA	17-4	mxAAA	320,058	10,700,127.85	0.18
91	VWLEASE	18	mxAAA	185,000	18,546,095.90	0.31
91	VWLEASE	18-2	mxAAA	168,500	16,885,119.28	0.28
91	VWLEASE	19-2	mxAAA	1,000,000	100,147,158.00	1.65
93	CETILEM	00221	mxA-1+	650,000	65,215,991.10	1.08
93	CHDRAUI	01720	F1+(mex)	500,000	50,065,629.00	0.83
95	CFE	21	mxAAA	600,000	60,186,340.80	0.99
95	CFECB	09-2U	Aaa.mx	93,081	15,473,543.80	0.26
95	FEFA	18V	mxAAA	563,151	58,450,731.59	0.97
95	FEFA	18-3	mxAAA	1,480,027	148,718,139.13	2.46
95	HITOTAL	10U	Aaa.mx	149,053	10,817,659.80	0.18
95	TFOVICB	13-3U	mxAAA	99,236	17,292,606.16	0.29
95	TFOVIS	14U	Aaa.mx	55,253	15,266,029.62	0.25
95	TFOVIS	14-3U	mxAAA	126,431	34,277,878.28	0.57
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					5,288,652,740.28	87.34
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					5,288,652,740.28	87.34
OPERACIONES DE REPORTO						
REPORTADOR						
LD	BONDESD	260212	mxAAA	6,811,489	675,776,851.72	11.16
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					675,776,851.72	11.16
OPERACIONES CON DERIVADOS						
FUTUROS						
FB	DC24	SP21		850	191,250.00	0.00
FB	DC24	SP21		500	112,500.00	0.00
FCSP	PE	U1		777	-2,940,572.34	-0.05
TOTAL OPERACIONES CON DERIVADOS					-2,636,822.34	-0.04
TOTAL DE INVERSION EN VALORES					6,055,565,941.94	100.00

CATEGORÍA
DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN
AAAI/S5(mex)

VaR Promedio
0.045%

Límite de VaR
0.490%

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