

# GBMfondos

GBMF3 GBM VALORES DE DEUDA, S.A. DE C.V., F.I.I.D.  
CARTEA DE VALORES AL 23 SEPTIEMBRE, 2021

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Canl. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
<b>DISPONIBILIDADES</b>						
<b>DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN</b>						
CHD	BANAMEX	3811506		1	15.64	0.00
CHD	JPMOR	3128888		369,605	7,403,003.35	0.21
<b>DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA</b>						
AIM	GBM	0777641		2,581,300	2,581,623.00	0.07
AIM	PGOLDMA	0103193		4,662,868	4,662,868.00	0.13
BI	CETES	211118	mxAAA	122,228	1,213,368.97	0.03
EAIM	FCSTONE	0002779		200,168	200,168.00	0.01
EAIM	PGOLDMA	0103193		7,054,999	7,054,999.00	0.20
<b>TOTAL DISPONIBILIDADES</b>					<b>23,116,045.96</b>	<b>0.65</b>
<b>TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>						
<b>INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA</b>						
<b>VALORES GUBERNAMENTALES</b>						
BI	CETES	211118	mxAAA	7,107,692	70,558,733.71	1.97
BI	CETES	211216	mxAAA	20,000,000	197,752,860.00	5.52
BI	CETES	220210	mxAAA	5,000,000	49,034,840.00	1.37
D1SP	UMS22F	20222F	BBB-	3,700	83,387,598.26	2.33
M	BONOS	220609	mxAAA	450,000	46,228,174.20	1.29
M	BONOS	230309	mxAAA	2,700,000	274,896,255.60	7.68
M	BONOS	231207	mxAAA	150,000	15,959,932.05	0.45
M	BONOS	241205	mxAAA	1,250,000	141,344,765.00	3.95
M	BONOS	310529	mxAAA	350,000	37,230,891.25	1.04
<b>TÍTULOS BANCARIOS</b>						
F	BANOBR	21067	mxA-1+	1,000,000	100,230,838.00	2.80
94	BACOMER	19	Aaa.mx	1,400,000	140,221,741.80	3.92
94	BINBUR	14-7	mxAAA	350,000	34,988,378.95	0.98
94	BLADEX	19	mxAAA	383,679	38,491,819.88	1.08
94	BSMX	18	Aaa.mx	37,100	3,725,728.17	0.10
94	BSMX	19	Aaa.mx	180,000	18,011,606.40	0.50
94	HSBC	19-2	Aaa.mx	1,000,000	100,140,977.00	2.80
<b>PAPEL PRIVADO</b>						
D2	CONM151	351215	mxAAA	87	1,380,876.52	0.04
JE	AMX	1122	mxAAA	6,000	61,477,341.13	1.72
JI	CABEI	1-19	mxAAA	1,200,000	120,561,792.00	3.37
90	PAMMCB	14U	mxAAA	79,238	48,533,535.85	1.36
91	ARA	17	mxA+	450,000	27,734,292.90	0.77
91	ATLASCB	19	HR AAA	200,000	20,112,244.60	0.56
91	BWMX	21X	AA(mex)	240,000	24,094,474.32	0.67
91	CETELEM	18-2	mxAAA	50,000	5,019,833.35	0.14
91	CETELEM	19	mxAAA	50,000	5,019,484.60	0.14
91	CETELEM	19-3	mxAAA	162,166	16,259,683.29	0.45
91	CETELEM	21	mxAAA	500,000	50,226,515.00	1.40
91	DAIMLER	19	mxAAA	200,000	20,383,643.60	0.57
91	DAIMLER	19-3	mxAAA	200,000	19,990,300.80	0.56
91	DAIMLER	20-2	mxAAA	150,000	15,161,680.20	0.42
91	DHIC	15	AA+(mex)	295,733	29,771,441.41	0.83
91	FERROMX	07-2	mxAAA	200,000	21,263,546.20	0.59
91	FERROMX	21-2	mxAAA	700,000	70,168,662.20	1.96
91	FLNO	17-2	AAA(mex)	250,000	24,963,683.00	0.70
91	GBM	19	AA-(mex)	1,020,000	102,215,092.50	2.85
91	GARSO	20	AA(mex)	300,000	30,104,258.40	0.84
91	GMXT	17-2	mxAAA	178,380	17,837,711.38	0.50
91	INCARSO	17	AA+(mex)	700,306	35,138,097.26	0.98
91	LALA	18-2	HR AA-	451,600	45,042,994.50	1.26
91	MONTPIO	17	HR AA+	197,000	19,753,623.79	0.55
91	SIPYTCB	13	mxD	80,526	4,237,183.58	0.12
91	SORIANA	20	AA+(mex)	400,000	40,104,176.00	1.12
91	STORAGE	21-2V	AA-(mex)	210,000	21,087,475.50	0.59
91	TIPMXCB	20-2	AAA(mex)	270,000	27,108,682.56	0.76
91	TOYOTA	17-4	mxAAA	260,529	8,693,634.41	0.24
91	VWLEASE	18	mxAAA	623,000	62,646,819.74	1.75
91	VWLEASE	18-2	mxAAA	250,000	25,103,444.50	0.70
91	VWLEASE	19-2	mxAAA	300,000	30,214,474.80	0.84
93	CHDRAUI	01720	F1+(mex)	500,000	50,161,512.00	1.40
93	TOYOTA	00921	mxA-1+	200,000	20,002,865.40	0.56
95	CFE	21	mxAAA	370,000	37,059,856.38	1.04
95	FEFA	17-8	mxAAA	1,288,000	129,425,892.01	3.61
95	FEFA	18-3	mxAAA	200,000	20,131,060.80	0.56
95	TFOVICB	13-3U	mxAAA	133,904	21,901,760.04	0.61
95	TFOVIS	14U	Aaa.mx	95,111	25,102,562.82	0.70
95	TFOVIS	14-2U	mxAAA	55,475	16,268,779.63	0.45
95	TFOVIS	14-3U	mxAAA	252,167	65,171,200.96	1.82
97	BRHCCB	08U	Ba3.mx	144,300	3.03	0.00
<b>TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA</b>					<b>2,788,841,333.23</b>	<b>77.89</b>
<b>TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>					<b>2,788,841,333.23</b>	<b>77.89</b>
<b>OPERACIONES DE REPORTE</b>						
<b>REPORTADOR</b>						
LD	BONDES	250619	mxAAA	1,475,286	146,622,626.66	4.10
LD	BONDES	260212	mxAAA	4,238,938	421,521,009.90	11.77
ZU	CBIC002	300117	mxAAA	10	8,859.30	0.00
ZU	CBIC004	310116	mxAAA	223,195	200,011,686.87	5.59
<b>TOTAL OPERACIONES DE REPORTE</b>					<b>768,164,182.73</b>	<b>21.45</b>
<b>OPERACIONES CON DERIVADOS</b>						
<b>FUTUROS</b>						
FB	DC24	DC21		830	145,250.00	0.00
FCSP	PE	Z1		194	155,426.50	0.00
<b>TOTAL OPERACIONES CON DERIVADOS</b>					<b>300,676.50</b>	<b>0.01</b>
<b>TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES</b>					<b>3,580,422,238.42</b>	<b>100.00</b>

CATEGORÍA  
DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN  
AAI/S4(mex)

VaR Promedio  
0.033%

Limite de VaR  
0.480%

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