

GBMfondos

GBMPAT GBM FONDO PATRIMONIAL, S.A. DE C.V., F.I.L.D.
CARTERA DE VALORES AL 23 SEPTIEMBRE, 2021

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN						
CHD	BANAMEX	3788504		1	14.60	0.00
CHD	JPMOR	5128621		353,001	7,070,428.72	0.12
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA						
AIM	GBM	0778088		4,198.500	4,199,026.00	0.07
AIM	PGOLDMA	0103190		7,691,328	7,691,328.00	0.14
BI	CETES	211118	mxAAA	198,805	1,973,556.12	0.03
EAIM	FCSTOBE	0002784		200,294	200,294.00	0.00
EAIM	PGOLDMA	0103190		6,722,049	6,722,049.00	0.12
TOTAL DISPONIBILIDADES					27,856,696.44	0.49
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
BI	CETES	211021	mxAAA	15,500,000	154,467,637.00	2.72
BI	CETES	211118	mxAAA	39,801,195	395,110,243.88	6.97
BI	CETES	220113	mxAAA	10,000,000	99,470,490.00	1.74
D1SP	UMS22F	2022F	BBB-	3,065	69,076,483.42	1.22
D1SP	UMS31F	2031F	BBB-	1,000	29,692,201.49	0.52
M	BONOS	220609	mxAAA	750,000	77,046,957.00	1.36
M	BONOS	230309	mxAAA	5,350,000	544,701,839.80	9.60
M	BONOS	231207	mxAAA	1,000,000	106,399,547.00	1.88
M	BONOS	240905	mxAAA	400,000	41,815,800.80	0.74
M	BONOS	241205	mxAAA	1,500,000	169,613,718.00	2.99
M	BONOS	290531	mxAAA	800,000	89,603,460.00	1.56
M	BONOS	310529	mxAAA	100,000	10,637,397.50	0.19
M	BONOS	471107	mxAAA	350,000	36,796,261.60	0.65
TÍTULOS BANCARIOS						
94	BACOMER	17-2	Aaa.mx	1,040,000	104,368,284.00	1.84
94	BACOMER	19	Aaa.mx	1,070,906	107,260,217.59	1.89
94	BINBUR	14-7	mxAAA	950,000	94,988,457.15	1.67
94	BINBUR	18	mxAAA	570,700	57,317,787.10	1.01
94	BLADEX	19	mxAAA	752,317	75,474,581.84	1.33
94	BSMX	19	Aaaa.mx	175,000	17,674,189.50	0.31
94	HSBC	13-2	Aaa.mx	750,000	78,845,454.75	1.39
94	HSBC	19-2	Aaa.mx	1,000,000	100,140,977.00	1.77
94	SCOTTAB	17-2	mxAAA	200,000	20,071,818.00	0.35
94	SCOTTAB	19-2	mxAAA	1,500,000	150,399,795.00	2.65
PAPEL PRIVADO						
D2	CONM151	351215	mxAAA	1,650	26,189,037.41	0.46
D2	REDC933	280610	BBB	3,000	27,671,589.26	0.49
D2SP	GCCAB90	240623	BBB	2,000	41,699,499.27	0.74
JE	AMX	1122	mxAAA	7,656	78,445,087.28	1.38
JJ	CABEI	1-19	mxAAA	2,050,000	205,959,728.00	3.63
90	PAMMBC	14U	mxAAA	98,724	60,468,775.00	1.07
91	AC	11-2	mxAAA	331,765	34,399,546.11	0.61
91	ARA	17	mx+	450,000	27,734,292.90	0.49
91	ATLASCB	19	HR AAA	100,000	10,056,122.30	0.18
91	BACHOCO	17	AAA(mex)	70,000	7,014,430.92	0.12
91	CETELM	18-2	mxAAA	50,000	5,019,833.35	0.09
91	DAIMLER	19	mxAAA	288,836	29,437,650.41	0.52
91	DAIMLER	20-2	mxAAA	250,000	25,269,467.00	0.45
91	DHC	15	AA+(mex)	300,000	30,201,000.30	0.53
91	FERROMX	07-2	mxAAA	1,000,000	106,317,731.00	1.87
91	FERROMX	21-2	mxAAA	600,000	60,144,567.60	1.06
91	FUNO	17-2	AAA(mex)	280,000	27,959,324.96	0.49
91	GAP	17-2	mxAAA	739,472	74,094,932.46	1.31
91	GAP	21	mxAAA	300,000	30,254,385.50	0.53
91	GBM	19	AA+(mex)	1,000,000	100,210,875.00	1.77
91	GBM	21	HR AA+	650,000	65,202,434.05	1.15
91	GCARSO	20	AAA(mex)	500,000	50,173,764.00	0.88
91	GMKT	17-2	mxAAA	199,060	19,905,677.92	0.35
91	GMKT	19-2	mxAAA	300,000	29,668,733.10	0.52
91	GRUMA	18	mxAA+	325,386	32,554,925.59	0.57
91	LALA	18-2	HR AA+	904,810	90,246,571.87	1.59
91	MONTEPIO	17	HR AA+	300,000	30,081,660.60	0.53
91	OSM	15	mx+	100,000	9,894,614.90	0.17
91	RCO	12	mxAAA	8,802	637,440.65	0.01
91	SCRECB	16-2	mxAA	200,000	3,527,352.40	0.06
91	SIPYTCB	13	mxD	76,782	4,040,178.70	0.07
91	SORIANA	20	AA+(mex)	950,000	95,247,418.00	1.68
91	STORAGE	21-2V	AA-(mex)	340,000	34,141,627.00	0.60
91	TIPMXCB	20	AAA(mex)	610,500	57,066,551.60	1.01
91	TOYOTA	17-3	mxAAA	133,000	6,763,807.17	0.12
91	TOYOTA	17-4	mxAAA	320,258	19,680,667.25	0.35
91	VWLEASE	18	mxAAA	185,000	18,602,988.21	0.33
91	VWLEASE	18-2	mxAAA	168,500	16,919,721.59	0.30
91	VWLEASE	19-2	mxAAA	1,000,000	100,714,916.00	1.78
91	VWLEASE	21	mxAAA	400,000	40,196,192.80	0.71
93	CETELM	00221	mxA-1+	650,000	65,112,463.00	1.15
93	CHDRAUI	01720	F1+(mex)	500,000	50,161,512.00	0.88
95	CFE	21	mxAAA	600,000	60,097,064.40	1.06
95	CFECS	09-2U	Aaa.mx	93,881	13,156,939.87	0.23
95	FEFA	18V	mxAAA	583,151	58,343,008.44	1.03
95	FEFA	18-3	mxAAA	1,480,027	148,972,567.61	2.63
95	HITOTAL	10U	Aaa.mx	133,525	9,641,976.18	0.17
95	TFOVIB	13-3U	mxAAA	99,236	16,231,352.75	0.29
95	TFOVIS	14U	Aaa.mx	55,253	14,582,675.83	0.26
95	TFOVIS	14-3U	mxAAA	126,431	32,675,409.98	0.58
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					4,822,553,368.71	85.02
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					4,822,553,368.71	85.02
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADOR						
LD	BONDES D	260212	mxAAA	8,259,574	821,334,016.64	14.48
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					821,334,016.64	14.48
OPERACIONES CON DERIVADOS						
FUTUROS						
FB	DC24	DC21		350	61,250.00	0.00
FB	DC24	DC21		1,000	175,000.00	0.00
FCSP	FE	21		320	256,978.60	0.00
TOTAL OPERACIONES CON DERIVADOS					492,623.60	0.01
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					5,672,236,705.39	100.00

CATEGORÍA
DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN
AAA(S)(mex)

VaR Promedio
0.055%

Limite de VaR
0.490%

Para llevar a cabo la estimación del Valor en Riesgo (VaR) de mercado para los 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 período de muestra de un año
- El nivel de confianza para el VaR fijado al 95%
- El horizonte temporal para el que se estima la posible minusvalía será de 1 día