

# GBMfondos

## GBMF2 GBM FONDO DE CORTO PLAZO, S.A. DE C.V., F.I.I.D. CARTERA DE VALORES AL 31 AGOSTO, 2021

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
<b>DISPONIBILIDADES</b>						
<b>DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN</b>						
CHD	BANAMEX	3938506		1	19.88	0.00
CHD	JPMOR	3128912		35,694	716,646.29	0.01
<b>TOTAL DISPONIBILIDADES</b>					<b>716,666.17</b>	<b>0.01</b>
<b>TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>						
<b>INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA</b>						
<b>VALORES GUBERNAMENTALES</b>						
BI	CETES	210923	mxAAA	67,500,000	673,149,285.00	11.19
BI	CETES	211007	mxAAA	20,000,000	199,106,420.00	3.31
BI	CETES	211118	mxAAA	40,000,000	395,928,520.00	6.58
BI	CETES	211202	mxAAA	10,000,000	98,798,180.00	1.64
M	BONOS	211209	mxAAA	2,900,000	296,701,978.30	4.93
<b>TÍTULOS BANCARIOS</b>						
CD	BANOB	19	mxAAA	105,000	10,539,625.85	0.18
F	BANOBRA	21067	mxA-1+	2,500,000	250,692,965.00	4.17
F	SHF	20009	F1+(mex)	1,000,000	100,069,156.00	1.66
94	BACOMER	18	Aaa.mx	500,000	50,050,798.50	0.83
94	BACOMER	18V	Aaa.mx	205,000	20,517,677.36	0.34
94	BACOMER	19	Aaa.mx	1,130,490	113,236,297.32	1.88
94	BANORTE	19	mxAAA	922,968	92,627,888.00	1.54
94	BSMX	19	Aaa.mx	106,027	10,616,873.27	0.18
94	HSBC	19-2	Aaa.mx	300,000	30,064,545.00	0.50
94	SCOTIAB	17-2	mxAAA	550,000	55,251,851.05	0.92
94	SCOTIAB	18	mxAAA	293,458	29,390,993.41	0.49
94	SCOTIAB	19-2	mxAAA	626,000	62,742,768.06	1.04
<b>PAPEL PRIVADO</b>						
J1	CABEI	1-19	mxAAA	1,888,115	189,892,978.29	3.16
91	DAIMLER	19-3	mxAAA	184,200	18,417,964.41	0.31
91	DHIC	15	AA+(mex)	218,000	21,964,509.56	0.37
91	GBM	19	AA-(mex)	500,000	50,145,470.00	0.83
91	GBM	21	HR AA+	900,000	90,329,088.60	1.50
91	INCARSO	17	AA+(mex)	1,600,000	80,332,849.60	1.34
91	VWLEASE	18-2	mxAAA	474,000	47,437,710.49	0.79
91	VWLEASE	19-2	mxAAA	600,000	60,363,663.60	1.00
91	VWLEASE	21	mxAAA	200,000	20,048,447.00	0.33
93	CETELM	00321	mxA-1+	244,099	24,495,248.48	0.41
93	CETELM	00521	mxA-1+	100,000	10,008,515.60	0.17
93	NAVISTS	01021	HR+1	400,000	40,086,164.80	0.67
93	NAVISTS	01221	HR+1	310,000	31,035,571.88	0.52
93	TOYOTA	00221	mxA-1+	356,585	35,721,604.13	0.59
93	TOYOTA	01121	mxA-1+	113,470	11,376,099.04	0.19
95	CFE	21	mxAAA	530,000	53,134,617.35	0.88
95	FEFA	17-5	mxAAA	192,624	19,361,975.05	0.32
95	FEFA	18-3	mxAAA	100,000	10,034,260.80	0.17
95	FEFA	19V	mxAAA	800,000	80,089,540.80	1.33
95	FEFA	20-3	mxAAA	800,000	80,154,384.80	1.33
<b>TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA</b>					<b>3,463,916,486.40</b>	<b>57.57</b>
<b>TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>					<b>3,463,916,486.40</b>	<b>57.57</b>
<b>OPERACIONES DE REPORTE</b>						
<b>REPORTADOR</b>						
IS	BPA182	270930	mxAAA	3,968,555	400,051,367.71	6.65
LD	BONDESD	250220	mxAAA	12,559,788	1,252,097,146.76	20.81
2U	CBIC002	300117	mxAAA	1,019,527	900,093,718.02	14.96
<b>TOTAL OPERACIONES DE REPORTE</b>					<b>2,552,242,232.49</b>	<b>42.42</b>
<b>TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES</b>					<b>6,016,875,385.06</b>	<b>100.00</b>

### CATEGORÍA CORTO PLAZO

**CALIFICACIÓN**  
AAA/S2(mex)

**VaR Promedio**  
0.002%

**Límite de VaR**  
0.250%

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