

# GBMfondos

GBMF3 GBM VALORES DE DEUDA, 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	3811506		1	15.68	0.00
CHD	JPMOR	3128888		269,605	5,412,994.39	0.15
<b>DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA</b>						
AIM	GBM	0777641		2,581,300	2,581,626.00	0.07
AIM	PGOLDMA	0103193		4,674,042	4,674,042.00	0.13
BI	CETES	211118	mxAAA	122,586	1,213,382.34	0.03
EAIM	FCSTONE	0002779		200,648	200,648.00	0.01
EAIM	PGOLDMA	0103193		8,474,313	8,474,313.00	0.23
<b>TOTAL DISPONIBILIDADES</b>					<b>22,557,023.41</b>	<b>0.62</b>
<b>TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>						
<b>INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA</b>						
<b>VALORES GUBERNAMENTALES</b>						
BI	CETES	210902	mxAAA	207,500	2,074,735.44	0.06
BI	CETES	210923	mxAAA	15,000,000	149,588,730.00	4.14
BI	CETES	211118	mxAAA	21,877,414	216,547,303.66	6.00
BI	CETES	211216	mxAAA	20,000,000	197,198,600.00	5.46
BI	CETES	220210	mxAAA	5,000,000	48,882,730.00	1.35
D1SP	UMS2ZF	2022F	BBB-	3,700	83,026,559.34	2.30
M	BONOS	220609	mxAAA	200,000	20,487,865.00	0.57
M	BONOS	230309	mxAAA	2,700,000	283,917,425.40	7.86
M	BONOS	231207	mxAAA	150,000	15,987,819.90	0.44
M	BONOS	241205	mxAAA	1,250,000	142,065,932.50	3.94
M	BONOS	310529	mxAAA	350,000	37,520,093.45	1.04
<b>TÍTULOS BANCARIOS</b>						
F	BANOBRA	21067	mxA-1+	1,000,000	100,277,186.00	2.78
94	BACOMER	19	Aaa.mx	1,400,000	140,231,949.20	3.88
94	BINBUR	14-7	mxAAA	350,000	36,309,355.60	1.01
94	BLADEX	19	mxAAA	383,679	38,525,292.80	1.07
94	BSMX	18	Aaa.mx	37,100	3,714,272.73	0.10
94	BSMX	19	Aaa.mx	180,000	18,024,061.68	0.50
94	HSBC	19-2	Aaa.mx	1,000,000	100,215,150.00	2.78
<b>PAPEL PRIVADO</b>						
D2	CONM151	351215	mxAAA	87	1,379,354.25	0.04
JE	AMX	1122	mxAAA	6,000	61,295,719.65	1.70
JI	CABEI	1-19	mxAAA	1,200,000	120,687,338.40	3.34
90	PAMMCB	14U	mxAAA	79,238	48,434,919.64	1.34
91	ARA	17	mxA+	450,000	29,497,077.90	0.82
91	ATLASC	19	HR AAA	200,000	20,025,298.00	0.55
91	BWMX	21X	AA(mex)	240,000	24,006,870.00	0.67
91	CETELM	18-2	mxAAA	50,000	5,004,080.65	0.14
91	CETELM	19	mxAAA	50,000	5,022,700.25	0.14
91	CETELM	19-3	mxAAA	162,166	16,272,953.33	0.45
91	DAILER	19	mxAAA	200,000	21,225,723.80	0.59
91	DAILER	19-3	mxAAA	200,000	19,997,789.80	0.55
91	DAILER	20-2	mxAAA	150,000	15,696,966.00	0.43
91	DHIC	15	AA+(mex)	295,733	29,796,469.29	0.83
91	FERROMX	07-2	mxAAA	200,000	21,222,089.20	0.59
91	FERROMX	21-2	mxAAA	700,000	70,204,358.70	1.94
91	FUNO	17-2	AAA(mex)	250,000	24,974,998.00	0.69
91	GBM	19	AA-(mex)	1,020,000	102,296,758.80	2.83
91	GCARSO	20	AAA(mex)	300,000	30,008,902.50	0.83
91	GMXT	17-2	mxAAA	178,380	17,849,910.61	0.49
91	INCARSO	17	AA+(mex)	700,306	35,160,985.36	0.97
91	LALA	18-2	HR AA-	451,600	45,070,199.34	1.25
91	MONTPIO	17	HR AA+	197,000	19,780,111.43	0.55
91	SIFITCB	13	mxD	80,526	4,196,760.17	0.12
91	SORIANA	20	AA-(mex)	400,000	40,141,896.00	1.11
91	STORAGE	21-2V	AA-(mex)	210,000	21,003,652.95	0.58
91	TIPMXCB	20-2	AAA(mex)	270,000	27,151,997.58	0.75
91	TOYOTA	17-4	mxAAA	260,529	8,700,240.90	0.24
91	VWLEASE	18	mxAAA	623,000	62,396,540.08	1.73
91	VWLEASE	18-2	mxAAA	250,000	25,019,889.50	0.69
91	VWLEASE	19-2	mxAAA	300,000	30,181,831.80	0.84
93	CHDRAUI	01720	F1+(mex)	500,000	50,189,697.00	1.39
93	TOYOTA	00921	mxA-1+	200,000	20,016,674.40	0.55
95	CPE	21	mxAAA	370,000	37,093,978.15	1.03
95	FEFA	17-8	mxAAA	1,288,000	129,513,626.70	3.59
95	FEFA	18-3	mxAAA	200,000	20,068,521.60	0.56
95	TFOV/CB	13-3U	mxAAA	133,904	21,799,575.08	0.60
95	TFOVIS	14U	Aaa.mx	95,111	25,044,927.64	0.69
95	TFOVIS	14-2U	mxAAA	55,475	16,240,696.46	0.45
95	TFOVIS	14-3U	mxAAA	252,167	64,718,352.65	1.79
97	BRHCCB	08U	Ba3.mx	144,300	3.03	0.00
<b>TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA</b>					<b>3,022,985,499.29</b>	<b>83.74</b>
<b>TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>					<b>3,022,985,499.29</b>	<b>83.74</b>
<b>OPERACIONES DE REPORTE</b>						
<b>REPORTADOR</b>						
LD	BONDES	260212	mxAAA	3,660,719	364,183,522.11	10.09
2U	CBIC002	300117	mxAAA	113,280	100,009,726.45	2.77
2U	CBIC004	310116	mxAAA	112,096	100,011,003.62	2.77
<b>TOTAL OPERACIONES DE REPORTE</b>					<b>564,204,252.18</b>	<b>15.63</b>
<b>OPERACIONES CON DERIVADOS</b>						
<b>FUTUROS</b>						
FB	DC24	SP21		830	20,750.00	0.00
FCSP	PE	U1		194	253,121.57	0.01
<b>TOTAL OPERACIONES CON DERIVADOS</b>					<b>273,871.57</b>	<b>0.01</b>
<b>TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES</b>					<b>3,610,020,646.45</b>	<b>100.00</b>

**CATEGORÍA**  
DISCRECIONAL

**CALIFICACIÓN**  
AAI/S4(mex)

**VaR Promedio**  
0.034%

**Límite 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