

gbmfondos

GBMPAT GBM FONDO PATRIMONIAL, S.A. DE C.V., F.I.I.D.
CARTERA DE VALORES AL 31 DICIEMBRE, 2021

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DISPONIBILIDADES						
DISPONIBILIDADES SIN RESTRICCIÓN						
CHD	BANAMEX	3788504		1	14.95	0.00
CHD	JPMOR	3128821		452,473	9,279,085.33	0.19
DISPONIBILIDADES RESTRINGIDAS O DADAS EN GARANTÍA						
BI	CETES	220203	mxAAA	198,351	1,974,194.05	0.04
TOTAL DISPONIBILIDADES					11,253,294.33	0.23
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA						
VALORES GUBERNAMENTALES						
BI	CETES	220203	mxAAA	201,649	2,007,019.15	0.04
BI	CETES	220331	mxAAA	12,012,100	118,461,300.16	2.44
BI	CETES	220922	mxAAA	24,000,000	228,811,296.00	4.70
D1SP	UMS22F	2022F	BBB-	1,565	34,442,272.77	0.71
D1SP	UMS31F	2031F	BBB-	1,000	30,453,179.50	0.63
M	BONOS	231207	mxAAA	1,000,000	101,998,341.00	2.10
M	BONOS	240905	mxAAA	2,850,000	297,404,496.75	6.11
M	BONOS	241205	mxAAA	1,450,000	156,375,960.50	3.21
M	BONOS	230531	mxAAA	800,000	85,184,360.00	1.75
S	UDIBONO	220609	mxAAA	325,585	231,387,274.92	4.76
TÍTULOS BANCARIOS						
94	BACOMER	17-2	Aaa.mx	1,040,000	104,189,437.04	2.14
94	BACOMER	19	Aaa.mx	1,070,906	107,170,350.37	2.20
94	BINBUR	14-7	mxAAA	950,000	95,703,306.50	1.97
94	BINBUR	18	mxAAA	570,700	57,212,730.93	1.18
94	BLADEX	19	mxAAA	752,317	75,676,841.45	1.56
94	BLADEX	20	mxAAA	500,000	50,513,106.00	1.04
94	BSMX	18	Aaa.mx	175,000	17,547,878.78	0.36
94	HSBC	13-2	Aaa.mx	750,000	75,895,813.50	1.56
94	HSBC	19-2	Aaa.mx	1,000,000	100,375,081.00	2.06
94	SCOTIAB	17-2	mxAAA	200,000	20,106,757.20	0.41
94	SCOTIAB	19-2	mxAAA	1,500,000	150,204,778.50	3.09
PAPEL PRIVADO						
AIM	GBM	0778088		4,198,500	4,200,400.00	0.09
AIM	PGOLDMA	0103190		6,152,250	6,152,250.00	0.13
D2	CONM151	351215	mxAAA	1,650	25,758,769.85	0.53
D2	REDC933	280610	BBB	3,000	25,310,966.58	0.52
D2SP	GCCAB00	240623	BBB-	2,000	42,163,478.77	0.87
EAIM	FOSTONE	0002784		205,074	205,074.00	0.00
EAIM	PGOLDMA	0103190		7,566,550	7,566,550.00	0.16
JE	AMX	1122	mxAAA	7,656	76,673,562.87	1.58
JI	CABEI	11-19	mxAAA	2,050,000	206,008,028.05	4.24
90	PAMMIB	14U	mxAAA	98,724	57,664,863.64	1.19
91	ARA	21X	AA-(mex)	800,000	80,254,779.20	1.65
91	ATLASCB	19	HR,AAA	100,000	10,017,816.50	0.21
91	BACHOCO	17	AAA(mex)	70,000	7,003,953.81	0.14
91	DAIMLER	19	mxAAA	288,836	29,881,162.71	0.61
91	DAIMLER	20-2	mxAAA	450,000	45,901,142.10	0.94
91	DIRC	15	AA-(mex)	300,000	30,136,360.20	0.62
91	FERROMX	07-2	mxAAA	1,000,000	102,889,791.00	2.12
91	FERROMX	21-2	mxAAA	600,000	60,077,103.60	1.24
91	FLUNO	18	AAA(mex)	200,000	20,062,790.00	0.41
91	GAP	17-2	mxAAA	739,472	74,082,876.10	1.52
91	GAP	21	mxAAA	300,000	30,195,847.40	0.62
91	GBM	19	AA-(mex)	1,000,000	100,466,518.00	2.07
91	GBM	21	HR,AA+	650,000	65,115,267.75	1.34
91	GCARSO	20	AAA(mex)	500,000	50,105,903.50	1.03
91	GMXT	17-2	mxAAA	249,060	24,970,410.15	0.51
91	GMXT	19-2	mxAAA	500,000	49,899,851.50	1.02
91	GRUMA	18	mxAAA	343,764	34,479,188.19	0.71
91	LALA	18-2	HR,AA-	904,810	90,550,247.82	1.86
91	LIVEPOL	12-2	mxAAA	183,470	18,772,839.19	0.39
91	OSM	15	mxAA-	100,000	9,890,405.20	0.20
91	ROO	12	mxAAA	8,802	833,285.53	0.01
91	SCRECB	16-2	mxAA	200,000	1,201,950.20	0.02
91	SIPYTCB	13	mxD	76,782	4,057,737.97	0.08
91	SORIANA	20	AA+(mex)	950,000	95,518,408.35	1.96
91	STORAGE	21-2V	AA-(mex)	340,000	34,119,300.56	0.70
91	TIPMOCB	20	AA-(mex)	610,500	56,420,579.72	1.15
91	TOYOTA	17-3	mxAAA	251,000	12,933,934.62	0.27
91	VWLEASE	18	mxAAA	185,000	18,569,776.27	0.38
91	VWLEASE	19-2	mxAAA	1,000,000	100,518,787.00	2.07
91	VWLEASE	21	mxAAA	400,000	40,308,280.40	0.83
91	CETELM	00221	mxA-1+	650,000	65,257,716.55	1.34
95	CFE	21	mxAAA	600,000	60,343,781.40	1.24
95	CFECB	09-2U	Aaa.mx	93,081	13,530,753.73	0.28
95	FEFA	18-3	mxAAA	1,480,027	148,755,709.62	3.06
95	HITOTAL	10U	Aaa.mx	125,761	9,258,905.75	0.19
95	TFOVFCB	13-3U	mxAAA	99,236	14,958,242.10	0.31
95	TFOVIS	14U	Aaa.mx	55,253	13,813,784.74	0.28
95	TFOVIS	14-3U	mxAAA	126,431	30,828,067.85	0.63
TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA					4,248,408,782.06	87.34
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					4,248,408,782.06	87.34
OPERACIONES DE REPORTO						
LD	BONDESD	250416	mxAAA	6,082,194	604,305,577.40	12.42
TOTAL OPERACIONES DE REPORTO					604,305,577.40	12.42
OPERACIONES CON DERIVADOS						
FUTUROS						
FB	DC24	MR22		1,350	33,750.00	0.00
FCSP	PE	H2		250	51,212.89	0.00
TOTAL OPERACIONES CON DERIVADOS					84,962.89	0.00
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					4,864,052,616.68	100.00

CATEGORÍA
DISCRECIONAL

CALIFICACIÓN
AAA/ISS(mex)

VaR Promedio
0.054%

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 período 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