

# GBMfondos

## GBMF2 GBM FONDO DE CORTO PLAZO, S.A. DE C.V., F.I.I.D. CARTERA DE VALORES AL 25 ABRIL, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
<b>DIRECTO</b>						
<b>BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D</b>						
LD	BONDES	251016	mxAAA	2,000,000	200,978,616.00	3.88
LD	BONDES	241219	mxAAA	1,078,639	108,291,768.05	2.09
<b>BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F</b>						
LF	BONDES	270128	mxAAA	3,000,000	298,850,469.00	5.77
LF	BONDES	261022	mxAAA	2,000,000	200,194,466.00	3.86
LF	BONDES	251002	mxAAA	1,231,394	123,237,965.70	2.38
<b>CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS</b>						
OTROS TIPO DE VALOR 94 - CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS				1,641,818	164,657,637.17	3.18
<b>CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO</b>						
OTROS TIPO DE VALOR 93 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO				2,319,753	228,980,644.53	4.42
<b>CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS</b>						
91	ORBI	22L	AAA(mex)	1,168,532	116,943,146.58	2.26
91	CETELEM	21-3	mxAAA	1,050,000	105,699,460.65	2.04
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS				4,320,000	409,066,569.87	7.89
<b>CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL</b>						
95	FEFA	19-3	mxAAA	1,106,659	110,934,876.79	2.14
<b>TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES</b>						
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	1,400,000	140,747,919.20	2.72
<b>TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC</b>						
OTROS TIPO DE VALOR D8 - TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC				667	229,571,336.76	4.43
<b>TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO</b>					<b>2,438,154,876.30</b>	<b>47.04</b>
<b>REPORTO</b>						
IM	BPAG28	261105	mxAAA	10,653,996	1,061,603,862.57	20.48
LF	BONDES	260226	mxAAA	9,034,482	900,274,434.61	17.37
2U	CBIC004	310116	mxAAA	536,196	450,133,306.50	8.68
<b>TOTAL REPORTO</b>					<b>2,412,011,603.68</b>	<b>46.54</b>
<b>OTROS VALORES</b>				23,556,054	<b>332,953,939.70</b>	<b>6.42</b>
<b>TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES</b>					<b>5,183,120,419.68</b>	<b>100.00</b>

### CATEGORÍA IDCP

**CALIFICACIÓN**  
AAAf/S1(mex)

**VaR Promedio**  
0.004%

**Limite de VaR**  
0.197%

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

Lic. Julio Andres Maza Casas