

GBMfondos

GBMF2 GBM FONDO DE CORTO PLAZO, S.A. DE C.V., F.I.I.D.
CARTERA DE VALORES AL 16 MAYO, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D						
LD	BONDES	251016	mxAAA	2,000,000	200,615,240.00	3.87
LD	BONDES	241219	mxAAA	1,078,639	108,079,104.66	2.09
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDES	270128	mxAAA	3,000,000	300,880,308.00	5.81
LF	BONDES	261022	mxAAA	2,000,000	199,800,356.00	3.86
LF	BONDES	251002	mxAAA	1,231,394	122,993,215.06	2.37
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS						
94	BANORTE	23-2	AAA.mx	2,100,000	211,906,333.80	4.09
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO						
OTROS TIPO DE VALOR 93 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO				3,229,424	316,168,908.15	6.10
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
91	ORBITA	22L	AAA(mex)	1,168,532	117,734,793.12	2.27
91	CETELEM	21-3	mxAAA	1,050,000	105,469,077.00	2.04
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS				4,320,000	408,803,258.17	7.89
CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL						
95	FEFA	19-3	mxAAA	1,106,659	111,661,770.26	2.16
TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES						
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	1,400,000	140,434,856.80	2.71
TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC						
OTROS TIPO DE VALOR D8 - TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC				667	229,865,754.38	4.44
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					2,574,412,975.40	49.70
REPORTO						
LD	BONDES	250220	mxAAA	13,023,213	1,300,397,941.50	25.10
2U	CBIC004	310116	mxAAA	523,652	450,132,992.69	8.69
LF	BONDES	270930	mxAAA	4,104,077	408,453,279.02	7.89
TOTAL REPORTO					2,158,984,213.21	41.68
OTROS VALORES				24,773,433	446,564,126.63	8.62
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					5,179,961,315.24	100.00

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