

GBMfondos

GBMF3 GBM VALORES DE DEUDA, S.A. DE C.V., F.I.I.D. CARTERA DE VALORES AL 31 MAYO, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDES F	261203	mxAAA	6,000,000	599,915,814.00	9.70
OTROS TIPO DE VALOR LF - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F				1,612,096	161,729,342.04	2.61
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA						
M	BONOS	260305	mxAAA	2,400,000	224,839,833.60	3.63
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES						
S	UDIBONO	251204	mxAAA	602,617	484,346,099.18	7.83
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS						
OTROS TIPO DE VALOR 94 - CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS				2,760,000	277,493,493.62	4.49
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO						
OTROS TIPO DE VALOR 93 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO				2,618,264	255,127,122.57	4.12
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
91	ORBIA	22L	AAA(mex)	1,590,000	159,629,872.14	2.58
91	CETELEM	21-3	mxAAA	1,300,000	130,135,207.80	2.10
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS				13,796,647	1,349,111,032.86	21.81
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	241003	mxAAA	30,500,000	293,853,744.50	4.75
EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS						
OTROS TIPO DE VALOR D2 - EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS				1,667	166,406,377.49	2.69
TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES						
JI	CABEI	1-22S	mxAAA	1,400,000	141,046,729.60	2.28
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	1,370,000	138,372,112.54	2.24
TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC						
D8	CIT1125	FLOAT	A	62	156,812,255.09	2.54
D8	MSF0925	FLOAT	A-	54	135,749,634.79	2.19
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					4,674,568,671.82	75.57
REPORTO						
2U	CBIC004	310116	mxAAA	644,228	550,492,325.09	8.90
LD	BONDES D	250220	mxAAA	4,977,882	499,697,941.24	8.08
TOTAL REPORTO					1,050,190,266.33	16.98
OTROS VALORES				51,673,691	461,189,437.36	7.46
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					6,185,948,375.51	100.00

CATEGORÍA IDDIS

CALIFICACIÓN
AAA/S4(mex)

VaR Promedio
0.016%

Límite de VaR
0.470%

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