

GBMfondos

GBMF2 GBM FONDO DE CORTO PLAZO, S.A. DE C.V., F.I.I.D.
CARTERA DE VALORES AL 28 JUNIO, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D						
LD	BONDESD	260212	mxAAA	2,332,924	234,643,377.63	4.43
LD	BONDESD	251016	mxAAA	2,000,000	199,963,644.00	3.78
LD	BONDESD	241219	mxAAA	1,078,639	108,652,019.45	2.05
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDESF	270128	mxAAA	3,000,000	299,908,503.00	5.66
LF	BONDESF	261022	mxAAA	2,000,000	200,883,800.00	3.79
LF	BONDESF	261231	mxAAA	2,000,000	199,915,876.00	3.77
LF	BONDESF	251002	mxAAA	1,231,394	123,657,179.01	2.33
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS						
94	BANORTE	23-2	AAA.mx	2,100,000	211,091,689.20	3.99
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO						
OTROS TIPO DE VALOR 93 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO				3,200,132	312,458,516.87	5.90
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
91	ORBIA	22L	AAA(mex)	1,168,532	117,313,933.47	2.21
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS				5,207,080	473,233,807.05	8.93
CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL						
95	FEFA	23	mxAAA	1,450,000	145,523,899.50	2.75
CERTIFICADOS DE DEPÓSITO						
F	BANOBRA	23064	mxAAA	2,000,000	200,191,096.00	3.78
TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES						
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	1,400,000	141,398,468.40	2.67
JI	CABEI	1-24S	mxAAA	1,170,000	117,185,624.01	2.21
TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC						
OTROS TIPO DE VALOR D8 - TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC				667	228,965,411.42	4.32
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					3,314,986,845.01	62.58
REPORTO						
LD	BONDESD	250220	mxAAA	6,091,907	611,632,423.64	11.55
IM	BPAG28	260806	mxAAA	5,107,245	511,400,837.69	9.65
2U	CBIC004	310116	mxAAA	529,660	450,404,975.11	8.50
TOTAL REPORTO					1,573,438,236.44	29.70
OTROS VALORES				23,798,132	408,626,615.50	7.71
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					5,297,051,696.95	100.00

CATEGORÍA
IDCP

CALIFICACIÓN
AAAf/S1(mex)

VaR Promedio
0.005%

Límite 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