

GBMfondos

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

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D						
LD	BONDES	260212	mxAAA	2,332,924	234,446,968.75	3.97
LD	BONDES	251016	mxAAA	2,000,000	199,793,504.00	3.38
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDES	270128	mxAAA	3,000,000	299,587,383.00	5.07
LF	BONDES	261001	mxAAA	2,500,000	250,312,090.00	4.24
LF	BONDES	261022	mxAAA	2,000,000	200,676,418.00	3.40
LF	BONDES	261231	mxAAA	2,000,000	199,749,542.00	3.38
LF	BONDES	251002	mxAAA	1,231,394	123,552,213.76	2.09
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS						
94	BANORTE	23-2	AAA.mx	2,100,000	210,967,642.20	3.57
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO						
OTROS TIPO DE VALOR 93 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO				4,340,132	424,025,766.23	7.17
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
91	CETEM	21-3	mxAAA	1,700,000	171,530,528.70	2.90
91	ORBIA	22L	AAA(mex)	1,668,532	167,336,897.42	2.83
91	GAP	20	mxAAA	1,506,840	150,724,479.75	2.55
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS				4,157,080	368,723,502.52	6.24
CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL						
95	FEFA	23	mxAAA	1,450,000	145,396,663.45	2.46
CERTIFICADOS DE DEPÓSITO						
F	BANOBRA	23064	mxAAA	2,000,000	200,092,124.00	3.39
TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES						
J1	CABEI	1-23S	mxAAA	1,400,000	141,258,467.00	2.39
TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC						
OTROS TIPO DE VALOR D8 - TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC				67	168,613,630.85	2.85
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					3,656,787,821.63	61.87
REPORTO						
LF	BONDES	260226	mxAAA	7,008,448	700,213,851.31	11.85
2U	CBIC004	310116	mxAAA	707,907	600,177,520.57	10.16
IM	BPAG28	270506	mxAAA	5,516,176	552,651,256.70	9.35
TOTAL REPORTO					1,853,042,628.58	31.35
OTROS VALORES				24,081,826	400,239,414.47	6.77
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					5,910,069,864.68	100.00

	CATEGORÍA	
	IDCP	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
AAAf/S1(mex)	0.006%	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