

GBMfondos

GBMPAT GBM FONDO PATRIMONIAL, 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 F						
LF	BONDEF	261203	mxAAA	1,000,000	99,884,950.00	2.60
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA						
M	BONOS	260305	mxAAA	3,200,000	304,030,976.00	7.90
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES						
S	UDIBONO	251204	mxAAA	447,975	360,141,347.66	9.36
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS						
94	BINBUR	14-7	mxAAA	950,000	97,425,457.35	2.53
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
91	BBVALMX	18-2	AAA(mex)	1,020,000	105,651,683.64	2.75
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
				9,034,926	925,619,311.19	24.06
CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL						
OTROS TIPO DE VALOR 95 - CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DE						
				1,674,765	161,444,573.37	4.20
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	250626	mxAAA	43,500,000	393,577,603.50	10.23
BI	CETES	250320	mxAAA	20,000,000	186,220,660.00	4.84
EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS						
D2	BAC847	250216	A-	1,000	104,551,686.48	2.72
TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES						
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	1,030,000	103,925,872.15	2.70
OTROS TIPO DE VALOR JI - TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES						
				821,169	82,583,743.42	2.15
TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC						
D8	MSF0925	FLOAT	A-	39	97,931,267.34	2.55
D8	CIT1125	FLOAT	A	34	85,825,408.88	2.23
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					3,108,814,540.98	80.79
REPORTO						
LF	BONDEF	251204	mxAAA	3,680,555	367,948,597.66	9.56
TOTAL REPORTO					367,948,597.66	9.56
OTROS VALORES				27,841,172	371,136,840.49	9.65
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					3,847,899,979.13	100.00

	CATEGORÍA	
	IDDIS	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
AAA/S4(mex)	0.037%	0.690%

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