

GBMfondos

GBMF2 GBM FONDO DE CORTO PLAZO, S.A. DE C.V., F.I.I.D. CARTERA DE VALORES AL 30 SEPTIEMBRE, 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	233,328,896.26	4.04
LD	BONDES	251016	mxAAA	2,000,000	200,548,030.00	3.47
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDES	270128	mxAAA	3,000,000	300,711,612.00	5.20
LF	BONDES	261001	mxAAA	2,500,000	251,287,267.50	4.35
LF	BONDES	261231	mxAAA	2,000,000	200,493,340.00	3.47
LF	BONDES	261022	mxAAA	2,000,000	199,741,880.00	3.45
LF	BONDES	251002	mxAAA	1,231,394	124,012,482.97	2.15
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS						
94	BANORTE	23-2	AAA.mx	2,100,000	211,685,926.20	3.66
OTROS TIPO DE VALOR 94 - CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS				1,310,000	131,728,785.68	2.28
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE BANCA DE DESARROLLO						
CD	SHF	21-3	AAA(mex)	1,300,000	131,009,243.30	2.27
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO						
OTROS TIPO DE VALOR 93 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO				4,039,132	397,393,954.05	6.87
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
91	GAP	20	mxAAA	1,506,840	151,296,911.69	2.62
91	ORBIA	22L	AAA(mex)	1,488,532	149,839,880.88	2.59
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS				5,104,779	462,505,678.24	8.00
CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL						
95	FEFA	23	mxAAA	1,450,000	145,892,912.90	2.52
OTROS TIPO DE VALOR 95 - CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DE				1,400,000	141,057,332.40	2.44
CERTIFICADOS DE DEPÓSITO						
F	BANOBRA	23064	mxAAA	2,000,000	200,855,164.00	3.47
CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	241205	mxAAA	13,000,000	127,609,209.00	2.21
TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES						
JI	CABEI	1-24S	mxAAA	1,721,000	172,940,099.27	2.99
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	1,400,000	140,588,583.80	2.43
TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC						
OTROS TIPO DE VALOR D8 - TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC				67	169,193,501.65	2.93
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					4,243,720,691.79	73.40
REPORTO						
2U	CBIC004	310116	mxAAA	676,711	600,341,213.66	10.38
IQ	BPAG91	260507	mxAAA	3,771,682	383,036,273.69	6.63
LF	BONDES	261203	mxAAA	1,998,902	200,117,731.62	3.46
TOTAL REPORTO					1,183,495,218.97	20.47
OTROS VALORES				23,629,149	354,221,886.47	6.13
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					5,781,437,797.23	100.00

CATEGORÍA IDCP

CALIFICACIÓN
AAA/S1(mex)

VaR Promedio
0.005%

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