

GBMfondos

GBMF3 GBM VALORES DE DEUDA, S.A. DE C.V., F.I.I.D. CARTERA DE VALORES AL 03 OCTUBRE, 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	601,961,490.00	9.20
LF	BONDES F	270520	mxAAA	4,000,000	400,764,292.00	6.12
LF	BONDES F	261001	mxAAA	1,500,000	149,614,641.00	2.29
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES						
S	UDIBONO	251204	mxAAA	604,157	496,177,640.34	7.58
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS						
OTROS TIPO DE VALOR 94 - CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS				2,410,000	242,953,713.19	3.71
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO						
OTROS TIPO DE VALOR 93 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO				3,246,345	317,973,026.05	4.86
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
91	ORBIA	22L	AAA(mex)	1,430,000	144,036,332.44	2.20
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS				13,548,654	1,316,959,111.34	20.13
CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL						
OTROS TIPO DE VALOR 95 - CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DE				2,600,586	262,278,498.96	4.01
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	241226	mxAAA	30,000,000	292,915,740.00	4.48
BI	CETES	250220	mxAAA	20,000,000	192,229,080.00	2.94
BI	CETES	241205	mxAAA	13,500,000	132,595,380.00	2.03
OTROS TIPO DE VALOR BI - CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO				26,500,000	257,794,923.00	3.94
TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES						
J1	CABEI	1-22S	mxAAA	1,400,000	140,298,187.40	2.14
J1	CABEI	1-23S	mxAAA	1,370,000	137,658,794.64	2.10
TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC						
D8	CIT1125	FLOAT	A	62	157,077,672.56	2.40
D8	MSF0925	FLOAT	A-	54	136,190,646.34	2.08
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					5,379,479,169.26	82.21
REPORTO						
2U	CBIC004	310116	mxAAA	451,854	400,112,865.45	6.11
LF	BONDES F	270318	mxAAA	2,575,081	256,102,274.26	3.91
TOTAL REPORTO					656,215,139.71	10.03
OTROS VALORES				26,936,507	507,989,260.07	7.76
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					6,543,683,569.04	100.00

	CATEGORÍA IDDIS	
CALIFICACIÓN AAAf/S4(mex)	VaR Promedio 0.014%	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

Lic. Julio Andres Maza Casas