

GBMfondos

GBMPAT GBM FONDO PATRIMONIAL, 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 F						
LF	BONDES F	261203	mxAAA	1,000,000	100,262,176.00	2.49
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA						
M	BONOS	260305	mxAAA	1,250,000	119,270,678.75	2.96
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES						
S	UDIBONO	251204	mxAAA	353,791	290,490,938.58	7.22
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO						
OTROS TIPO DE VALOR 93 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO				1,212,366	116,506,268.78	2.89
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS				8,960,004	913,568,163.99	22.70
CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL						
95	FEFA	21-2	mxAAA	800,000	80,708,844.80	2.01
OTROS TIPO DE VALOR 95 - CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DE				1,881,684	188,558,382.76	4.68
CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	250626	mxAAA	21,500,000	199,879,093.00	4.97
BI	CETES	250320	mxAAA	20,000,000	190,689,480.00	4.74
BI	CETES	241205	mxAAA	8,500,000	83,436,790.50	2.07
EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS						
D2	BAC847	250216	A-	1,000	101,261,585.45	2.52
TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES						
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	1,030,000	103,433,029.51	2.57
OTROS TIPO DE VALOR JI - TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES				847,169	84,891,250.98	2.11
TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC						
D8	MSF0925	FLOAT	A-	39	98,297,194.65	2.44
D8	CIT1125	FLOAT	A	34	86,084,491.18	2.14
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					2,757,338,368.93	68.51
REPORTO						
LF	BONDES F	251002	mxAAA	9,352,955	940,926,478.87	23.38
TOTAL REPORTO					940,926,478.87	23.38
OTROS VALORES				20,093,523	326,675,964.97	8.12
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					4,024,940,812.77	100.00

CALIFICACIÓN
AAAf/S4(mex)

CATEGORÍA
IDDIS

VaR Promedio
0.025%

Límite de VaR
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