

GBMfondos

GBMF3 GBM VALORES DE DEUDA, S.A. DE C.V., F.I.I.D. CARTERA DE VALORES AL 28 JUNIO, 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	599,846,982.00	9.59
OTROS TIPO DE VALOR LF - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F				1,612,096	161,744,764.46	2.58
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA						
M	BONOS	260305	mxAAA	3,350,000	316,229,125.90	5.05
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES						
S	UDIBONO	251204	mxAAA	653,224	517,439,020.84	8.27
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS						
OTROS TIPO DE VALOR 94 - CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS				2,760,000	277,768,965.32	4.44
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO						
OTROS TIPO DE VALOR 93 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO				3,345,294	327,763,008.91	5.24
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
91	ORBIA	22L	AAA(mex)	1,590,000	159,626,911.56	2.55
91	CETEM	21-3	mxAAA	1,300,000	130,134,329.00	2.08
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS				13,096,647	1,278,398,757.34	20.43
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	241003	mxAAA	30,500,000	296,371,458.50	4.74
EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS						
OTROS TIPO DE VALOR D2 - EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS				1,667	167,922,511.05	2.68
TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES						
J1	CABEI	1-22S	mxAAA	1,400,000	141,042,314.00	2.25
J1	CABEI	1-23S	mxAAA	1,370,000	138,368,501.22	2.21
TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC						
D8	CIT1125	FLOAT	A	62	156,737,372.70	2.50
D8	MSF0925	FLOAT	A-	54	135,741,792.65	2.17
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					4,805,135,815.45	76.79
REPORTO						
2U	CBIC004	310116	mxAAA	647,362	550,494,780.61	8.80
LF	BONDES F	251002	mxAAA	3,185,510	319,494,549.50	5.11
TOTAL REPORTO					869,989,330.11	13.90
OTROS VALORES					582,104,486.91	9.30
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					6,257,229,632.47	100.00

CATEGORÍA IDDIS

CALIFICACIÓN
AAAf/S4(mex)

VaR Promedio
0.019%

Limite 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