

GBMfondos

GBMF3 GBM VALORES DE DEUDA, S.A. DE C.V., F.I.I.D.
CARTERA DE VALORES AL 18 JULIO, 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	598,008,198.00	9.40
LF	BONDES F	261001	mxAAA	1,500,000	149,860,948.50	2.36
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA						
M	BONOS	260305	mxAAA	2,550,000	241,748,466.00	3.80
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES						
S	UDIBONO	251204	mxAAA	653,224	522,471,895.55	8.22
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS						
OTROS TIPO DE VALOR 94 - CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS						
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO						
OTROS TIPO DE VALOR 93 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO						
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
91	ORBITA	22L	AAA(mex)	1,890,000	189,122,041.08	2.97
91	CETEMEM	21-3	mxAAA	1,300,000	130,882,884.60	2.06
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL						
OTROS TIPO DE VALOR 95 - CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES						
CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	241226	mxAAA	30,000,000	285,714,510.00	4.49
BI	CETES	250626	mxAAA	30,500,000	275,317,400.00	4.33
OTROS TIPO DE VALOR BI - CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS						
OTROS TIPO DE VALOR D2 - EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS						
TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES						
J1	CABEI	1-22S	mxAAA	1,400,000	140,591,396.40	2.21
J1	CABEI	1-23S	mxAAA	1,370,000	137,925,848.74	2.17
TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC						
D8	CIT1125	FLOAT	A	62	157,680,281.19	2.48
D8	MSF0925	FLOAT	A-	54	135,281,415.87	2.13
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					5,436,074,525.86	85.48
REPORTO						
2U	CBIC004	310116	mxAAA	458,698	400,118,398.90	6.29
LF	BONDES F	250424	mxAAA	1,776,815	177,461,040.27	2.79
TOTAL REPORTO					577,579,439.17	9.08
OTROS VALORES				27,167,984	346,106,140.94	5.44
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					6,359,760,105.97	100.00

CATEGORÍA
IDDIS

CALIFICACIÓN
AAAf/S4(mex)

VaR Promedio
0.020%

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