

# GBMfondos

GBMPAT GBM FONDO PATRIMONIAL, 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
<b>DIRECTO</b>						
<b>BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F</b>						
LF	BONDES F	261203	mxAAA	1,000,000	99,668,033.00	2.63
<b>BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA</b>						
M	BONOS	260305	mxAAA	3,200,000	303,370,624.00	8.02
<b>BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES</b>						
S	UDIBONO	251204	mxAAA	447,975	358,306,411.59	9.47
<b>CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS</b>						
94	BINBUR	14-7	mxAAA	950,000	97,213,289.10	2.57
<b>CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS</b>						
91	BBVALMX	18-2	AAA(mex)	1,020,000	105,415,328.22	2.79
<b>OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS</b>						
<b>CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL</b>						
<b>OTROS TIPO DE VALOR 95 - CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES</b>						
<b>CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO</b>						
BI	CETES	250626	mxAAA	43,500,000	392,665,800.00	10.38
BI	CETES	250320	mxAAA	20,000,000	185,844,940.00	4.91
<b>EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS</b>						
D2	BAC847	250216	A-	1,000	104,281,060.07	2.76
<b>TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES</b>						
J1	CABEI	1-23S	mxAAA	1,030,000	103,696,076.06	2.74
<b>OTROS TIPO DE VALOR J1 - TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES</b>						
<b>TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC</b>						
D8	MSF0925	FLOAT	A-	39	97,703,244.79	2.58
D8	CIT1125	FLOAT	A	34	86,469,831.62	2.29
<b>OTROS TIPO DE VALOR D8 - TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC</b>						
<b>TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO</b>					<b>3,156,911,573.68</b>	<b>83.45</b>
<b>REPORTO</b>						
LF	BONDES F	250424	mxAAA	2,949,611	294,595,124.69	7.79
<b>TOTAL REPORTO</b>					<b>294,595,124.69</b>	<b>7.79</b>
<b>OTROS VALORES</b>				31,216,360	<b>331,311,723.52</b>	<b>8.76</b>
<b>TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES</b>					<b>3,782,818,421.89</b>	<b>100.00</b>

CATEGORÍA  
IDDIS

CALIFICACIÓN  
AAAf/S4(mex)

VaR Promedio  
0.039%

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