

GBMfondos

GBMF2 GBM FONDO DE CORTO PLAZO, S.A. DE C.V., F.I.I.D.
CARTERA DE VALORES AL 29 NOVIEMBRE, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D						
LD	BONDESD	260212	mxAAA	2,332,924	233,701,466.56	3.54
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDESF	270422	mxAAA	4,000,000	401,263,232.00	6.08
LF	BONDESF	261001	mxAAA	4,000,000	399,433,200.00	6.05
LF	BONDESF	270128	mxAAA	3,000,000	301,163,532.00	4.56
LF	BONDESF	261231	mxAAA	2,000,000	200,827,276.00	3.04
LF	BONDESF	261022	mxAAA	2,000,000	200,054,358.00	3.03
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS						
94	BANORTE	23-2	AAA.mx	3,200,000	320,278,841.60	4.85
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO						
OTROS TIPO DE VALOR 93 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO				2,589,326	253,203,708.98	3.84
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
91	GAP	20	mxAAA	1,511,840	152,012,131.53	2.30
91	ORBIA	22L	AAA(mex)	1,488,532	150,038,705.59	2.27
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS				6,135,699	591,452,614.17	8.96
CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL						
95	FNCOT	22S	AAA(mex)	1,500,000	150,402,636.00	2.28
OTROS TIPO DE VALOR 95 - CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO				2,350,000	236,889,403.50	3.59
CERTIFICADOS DE DEPÓSITO						
F	BANOBRA	23064	mxAAA	2,300,000	231,295,465.80	3.50
F	HSBCMX	24012	mxA-1+	1,500,000	150,438,885.00	2.28
F	BSCTIA	24015	mxA-1+	1,500,000	150,306,943.50	2.28
PAGARÉ CON RENDIMIENTO LIQUIDABLE AL VENCIMIENTO						
I	BMORGAN	24534	mxA-1+	200,000,000	198,248,400.00	3.00
TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES						
JI	CABEI	1-24S	mxAAA	1,721,000	173,187,537.76	2.62
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	1,400,000	140,784,081.20	2.13
TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC						
OTROS TIPO DE VALOR D8 - TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC				67	169,351,193.78	2.57
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					4,804,333,612.97	72.78
REPORTO						
IQ	BPAG91	270506	mxAAA	9,170,396	922,267,174.60	13.97
2U	CBIC004	310116	mxAAA	168,454	150,127,474.33	2.27
TOTAL REPORTO					1,072,394,648.93	16.25
OTROS VALORES				38,956,822	724,087,339.14	10.97
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					6,600,815,601.04	100.00

CATEGORÍA IDCP

CALIFICACIÓN
AAA/S1(mex)

VaR Promedio
0.005%

Limite de VaR
0.197%

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