

GBMfondos

GBMF2 GBM FONDO DE CORTO PLAZO, S.A. DE C.V., F.I.I.D. CARTERA DE VALORES AL 11 DICIEMBRE, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D						
LD	BONDES	260212	mxAAA	2,332,924	234,450,430.81	3.67
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDEF	270422	mxAAA	4,000,000	399,296,984.00	6.26
LF	BONDEF	261001	mxAAA	3,000,000	300,534,360.00	4.71
LF	BONDEF	270128	mxAAA	3,000,000	299,688,183.00	4.70
LF	BONDEF	261022	mxAAA	2,000,000	200,696,484.00	3.15
LF	BONDEF	261231	mxAAA	2,000,000	199,843,468.00	3.13
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS						
94	BANORTE	23-2	AAA.mx	3,200,000	321,311,078.40	5.04
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE BANCA DE DESARROLLO						
CD	SHF	21-3	AAA(mex)	1,300,000	130,522,583.10	2.05
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO						
OTROS TIPO DE VALOR 93 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO				3,188,050	311,624,225.71	4.88
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
91	GAP	20	mxAAA	1,511,840	152,505,782.06	2.39
91	ORBJA	22L	AAA(mex)	1,488,532	149,248,402.27	2.34
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS				6,135,699	591,191,766.06	9.27
CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL						
95	FNCOT	22S	AAA(mex)	1,500,000	150,894,258.00	2.36
OTROS TIPO DE VALOR 95 - CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO				2,350,000	235,937,795.45	3.70
CERTIFICADOS DE DEPÓSITO						
F	BANOBRA	23064	mxAAA	2,300,000	230,123,045.40	3.61
F	HSBCMX	24012	mxA-1+	1,500,000	150,921,795.00	2.37
F	BSCTIA	24015	mxA-1+	1,500,000	150,788,577.00	2.36
PAGARÉ CON RENDIMIENTO LIQUIDABLE AL VENCIMIENTO						
I	BMORGAN	24534	mxA-1+	200,000,000	198,866,800.00	3.12
TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES						
J1	CABEI	1-24S	mxAAA	1,721,000	172,291,246.13	2.70
J1	CABEI	1-23S	mxAAA	1,400,000	141,241,406.60	2.21
TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC						
OTROS TIPO DE VALOR D8 - TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC				67	168,382,476.79	2.64
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					4,890,361,147.78	76.65
REPORTO						
IS	BPA182	301010	mxAAA	5,484,156	554,782,288.11	8.70
2U	CBIC004	310116	mxAAA	338,958	300,165,634.34	4.70
TOTAL REPORTO					854,947,922.45	13.40
OTROS VALORES				36,696,390	635,135,062.23	9.95
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					6,380,444,132.46	100.00

CATEGORÍA IDCP

CALIFICACIÓN
AAA/S1(mex)

VaR Promedio
0.005%

Límite 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