

GBMfondos

GBMPAT GBM FONDO PATRIMONIAL, S.A. DE C.V., F.I.I.D.
CARTERA DE VALORES AL 25 ABRIL, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDEF	261203	mxAAA	1,000,000	99,646,911.00	2.64
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA						
M	BONOS	260305	mxAAA	2,800,000	258,758,544.80	6.85
M	BONOS	240905	mxAAA	2,000,000	199,871,024.00	5.29
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES						
S	UDIBONO	251204	mxAAA	447,975	355,549,651.39	9.41
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS						
94	BINBUR	14-7	mxAAA	950,000	94,712,428.35	2.51
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
91	BBVALMX	18-2	AAA(mex)	1,020,000	102,628,447.50	2.72
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
				9,230,190	941,328,850.94	24.91
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	241003	mxAAA	18,500,000	176,190,707.00	4.66
EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS						
D2	BAC847	250216	A-	1,000	101,418,479.50	2.68
TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES						
J1	CABEI	1-23S	mxAAA	1,030,000	103,550,254.84	2.74
TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC						
D8	MSF0925	FLOAT	A-	39	97,722,675.69	2.59
D8	CIT1125	FLOAT	A	34	86,593,134.44	2.29
OTROS TIPO DE VALOR D8 - TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC						
				3,509	91,480,825.97	2.42
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					2,709,451,935.42	71.69
REPORTO						
LF	BONDEF	250227	mxAAA	6,009,735	600,098,415.65	15.88
TOTAL REPORTO					600,098,415.65	15.88
OTROS VALORES						
				46,133,994	469,958,572.99	12.43
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					3,779,508,924.06	100.00

CATEGORÍA IDDIS

CALIFICACIÓN
AAAf/S4(mex)

VaR Promedio
0.029%

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