

GBMfondos

GBMF2 GBM FONDO DE CORTO PLAZO, S.A. DE C.V., F.I.I.D. CARTERA DE VALORES AL 31 OCTUBRE, 2023

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D						
LD	BONDES	231221	mxAAA	5,500,000	550,944,619.50	12.88
LD	BONDES	241219	mxAAA	1,078,639	107,902,892.80	2.52
LD	BONDES	240229	mxAAA	1,000,000	100,583,963.00	2.35
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDES	250424	mxAAA	3,500,000	351,454,446.00	8.22
LF	BONDES	250130	mxAAA	2,000,000	200,905,152.00	4.70
LF	BONDES	250227	mxAAA	1,500,000	150,664,026.00	3.52
LF	BONDES	251002	mxAAA	1,231,394	123,817,292.25	2.89
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO						
OTROS TIPO DE VALOR 93 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO				2,608,689	260,926,859.06	6.10
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
91	ORBIA	22L	AAA(mex)	1,068,532	107,578,389.16	2.51
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS				3,680,000	329,393,023.74	7.70
CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL						
95	FEFA	19-3	mxAAA	1,000,000	101,023,188.00	2.36
TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES						
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	1,400,000	140,365,180.20	3.28
TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC						
OTROS TIPO DE VALOR D8 - TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC				693	295,697,770.16	6.91
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					2,821,256,801.87	65.95
REPORTO						
LF	BONDES	270930	mxAAA	7,976,952	798,930,728.97	18.68
LD	BONDES	260611	mxAAA	3,493,817	350,110,551.40	8.18
TOTAL REPORTO					1,149,041,280.37	26.86
OTROS VALORES				30,464,124	307,446,225.55	7.19
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					4,277,744,307.79	100.00

	CATEGORÍA	
	IDCP	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Limite de VaR
AAAf/S1(mex)	0.007%	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