

# GBMfondos

GBMF2 GBM FONDO DE CORTO PLAZO, S.A. DE C.V., F.I.I.D.  
CARTERA DE VALORES AL 23 NOVIEMBRE, 2023

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
<b>DIRECTO</b>						
<b>BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D</b>						
LD	BONDES	231221	mxAAA	5,500,000	550,125,774.00	12.62
LD	BONDES	241219	mxAAA	1,078,639	107,748,306.57	2.47
LD	BONDES	240229	mxAAA	1,000,000	100,437,102.00	2.30
<b>BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F</b>						
LF	BONDES	250424	mxAAA	3,500,000	350,953,666.00	8.05
LF	BONDES	250130	mxAAA	2,000,000	200,608,196.00	4.60
LF	BONDES	250227	mxAAA	1,500,000	150,445,683.00	3.45
LF	BONDES	251002	mxAAA	1,231,394	123,682,949.63	2.84
<b>CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO</b>						
OTROS TIPO DE VALOR 93 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO				3,013,977	301,452,466.70	6.91
<b>CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS</b>						
91	ORBI	22L	AAA(mex)	1,168,532	117,453,146.53	2.69
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS				3,680,000	323,249,684.25	7.41
<b>CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL</b>						
95	FEFA	19-3	mxAAA	1,000,000	100,839,286.00	2.31
<b>TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES</b>						
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	1,400,000	140,137,221.00	3.21
<b>TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC</b>						
D8	GSF0325	FLOAT	A2	41	103,291,435.00	2.37
OTROS TIPO DE VALOR D8 - TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC				661	214,511,127.60	4.92
<b>TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO</b>					<b>2,884,936,044.28</b>	<b>66.17</b>
<b>REPORTO</b>						
IQ	BPAG91	251231	mxAAA	7,159,223	725,424,265.40	16.64
LF	BONDES	261001	mxAAA	4,297,498	430,134,363.21	9.87
<b>TOTAL REPORTO</b>					<b>1,155,558,628.61</b>	<b>26.51</b>
<b>OTROS VALORES</b>				22,105,603	<b>319,086,629.10</b>	<b>7.32</b>
<b>TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES</b>					<b>4,359,581,301.99</b>	<b>100.00</b>

	<b>CATEGORÍA</b>	
	IDCP	
<b>CALIFICACIÓN</b>	<b>VaR Promedio</b>	<b>Límite de VaR</b>
AAA/S1(mex)	0.006%	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 período 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