

GBMfondos

GBMF3 GBM VALORES DE DEUDA, 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
DIRECTO						
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS						
94	BLADEX	23	mxAAA	1,200,000	120,690,417.60	2.14
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
91	ORBIA	22L	AAA(mex)	1,590,000	159,816,336.21	2.83
91	GAP	19	mxAAA	1,400,000	141,089,121.60	2.50
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
				9,348,031	904,383,698.39	16.00
CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL						
95	FEFA	19-3	mxAAA	1,550,000	156,300,893.30	2.77
EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS						
D2	BAC847	250216	A-	1,200	123,098,547.42	2.18
TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES						
J1	CABEI	1-22S	mxAAA	1,400,000	141,167,077.80	2.50
J1	CABEI	1-23S	mxAAA	1,370,000	137,134,280.55	2.43
TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC						
D8	CIT1125	FLOAT	A	62	157,533,720.68	2.79
D8	MSF0925	FLOAT	A-	54	136,008,302.69	2.41
D8	GSF0325	FLOAT	A2	50	125,965,164.63	2.23
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					2,303,187,560.87	40.74
REPORTO						
LF	BONDESF	251002	mxAAA	18,855,964	1,892,333,629.13	33.48
LF	BONDESF	250619	mxAAA	4,536,686	454,455,278.64	8.04
TOTAL REPORTO					2,346,788,907.77	41.51
OTROS VALORES				45,974,014	1,002,943,800.40	17.74
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					5,652,920,269.04	100.00

	CATEGORÍA	
	IDDIS	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
AAAf/S4(mex)	0.013%	0.470%

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