

GBMfondos

GBMPAT GBM FONDO PATRIMONIAL, 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 CON TASA DE INTERÉS FIJA						
M	BONOS	240905	mxAAA	2,200,000	216,424,711.80	6.16
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES						
S	UDIBONO	231116	mxAAA	314,540	252,364,639.46	7.19
S	UDIBONO	251204	mxAAA	252,643	195,702,654.91	5.57
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS						
94	BINBUR	14-7	mxAAA	950,000	95,038,679.25	2.71
94	HSBC	13-2	AAA.mx	750,000	77,388,012.00	2.20
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
91	BBVALMX	18-2	AAA(mex)	1,020,000	101,240,077.56	2.88
91	VWLEASE	21	mxAAA	1,000,000	100,757,498.00	2.87
91	ARA	21X	AA-(mex)	802,000	80,605,996.46	2.30
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS				5,182,595	537,917,244.08	15.32
EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS						
D2	BAC847	250216	A-	1,000	101,121,483.75	2.88
OTROS TIPO DE VALOR D2 - EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS				2,024	120,986,021.93	3.45
TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES						
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	1,030,000	103,268,668.29	2.94
JI	CABEI	1-22S	mxAAA	713,169	71,376,249.21	2.03
TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC						
D8	MSF0925	FLOAT	A-	39	98,400,915.26	2.80
D8	CIT1125	FLOAT	A	34	86,574,824.65	2.47
OTROS TIPO DE VALOR D8 - TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC				3,508	90,944,677.27	2.59
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					2,330,112,353.88	66.36
REPORTO						
LF	BONDESF	261001	mxAAA	7,436,000	745,115,540.15	21.22
LF	BONDESF	270422	mxAAA	1,001,690	100,031,580.36	2.85
TOTAL REPORTO					845,147,120.51	24.07
OTROS VALORES				26,976,954	336,189,349.27	9.57
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					3,511,448,823.66	100.00

	CATEGORÍA	
	IDDIS	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
AAAf/S4(mex)	0.052%	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

Lic. Julio Andres Maza Casas