

GBMfondos

GBMPAT GBM FONDO PATRIMONIAL, 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						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA						
M	BONOS	240905	mxAAA	800,000	79,498,918.40	2.28
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES						
S	UDIBONO	251204	mxAAA	138,183	108,940,798.52	3.12
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS						
94	BINBUR	14-7	mxAAA	950,000	95,821,247.45	2.74
94	HSBC	13-2	AAA.mx	750,000	77,986,201.50	2.23
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
91	BBVALMX	18-2	AAA(mex)	1,020,000	102,283,905.78	2.93
91	VWLEASE	21	mxAAA	1,000,000	100,579,277.00	2.88
91	ARA	21X	AA-(mex)	802,000	80,460,390.15	2.30
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS				5,182,595	535,080,615.80	15.32
EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS						
D2	BAC847	250216	A-	1,000	102,582,122.85	2.94
OTROS TIPO DE VALOR D2 - EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS				2,033	145,518,869.63	4.17
TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES						
J1	CABEI	1-23S	mxAAA	1,030,000	103,100,955.45	2.95
J1	CABEI	1-22S	mxAAA	713,169	71,911,416.93	2.06
TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC						
D8	MSF0925	FLOAT	A-	39	98,228,218.61	2.81
D8	CIT1125	FLOAT	A	34	86,389,459.73	2.47
OTROS TIPO DE VALOR D8 - TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC				3,508	91,074,259.96	2.61
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					1,879,456,657.76	53.79
REPORTO						
LF	BONDESF	251002	mxAAA	7,811,978	783,989,016.92	22.44
LF	BONDESF	251023	mxAAA	5,409,098	538,926,118.57	15.43
TOTAL REPORTO					1,322,915,135.49	37.86
OTROS VALORES				35,743,364	291,420,951.34	8.34
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					3,493,792,744.59	100.00

	CATEGORÍA	
	IDDIS	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Limite de VaR
AAAf/S4(mex)	0.047%	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