

GBMfondos

GBMF2 GBM FONDO DE CORTO PLAZO, S.A. DE C.V., F.I.I.D.
CARTERA DE VALORES AL 29 MAYO, 2025

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D						
LD	BONDES D	260212	mxAAA	2,332,924	234,402,825.17	3.98
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDES F	270422	mxAAA	8,000,000	799,398,928.00	13.59
LF	BONDES F	270128	mxAAA	3,000,000	299,894,796.00	5.10
LF	BONDES F	261022	mxAAA	2,000,000	200,744,722.00	3.41
LF	BONDES F	261231	mxAAA	2,000,000	199,979,286.00	3.40
LF	BONDES F	270520	mxAAA	2,000,000	199,830,110.00	3.40
OTROS TIPO DE VALOR LF - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F				2,000,000	200,018,215.00	3.40
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS						
OTROS TIPO DE VALOR 94 - CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS				1,340,000	134,638,833.17	2.29
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO						
OTROS TIPO DE VALOR 93 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO				4,303,265	424,273,304.16	7.21
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL						
OTROS TIPO DE VALOR 92 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL				1,215,524	118,640,332.24	2.02
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
91	ORBITA	25	AAA(mex)	1,450,000	145,816,368.85	2.48
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS				5,305,699	473,914,666.13	8.06
CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL						
95	FNCOT	22S	AAA.mx	1,500,000	150,838,342.50	2.56
95	FEFA	21-2	mxAAA	1,250,000	125,591,395.00	2.13
CERTIFICADOS DE DEPÓSITO						
F	HSBCMX	24012	mxA-1+	1,500,000	150,828,885.00	2.56
F	BSCTIA	24015	mxA-1+	1,500,000	150,716,485.50	2.56
TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES						
JI	CABEI	1-24S	mxAAA	1,721,000	172,351,105.95	2.93
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	1,400,000	141,126,297.20	2.40
TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC						
OTROS TIPO DE VALOR D8 - TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC				87	218,901,891.73	3.72
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					4,541,906,789.60	77.20
REPORTO						
IS	BPA182	301010	mxAAA	4,241,479	426,910,830.88	7.26
LF	BONDES F	290419	mxAAA	4,021,063	400,094,435.68	6.80
2U	CBIC002	300117	mxAAA	311,975	300,067,094.68	5.10
TOTAL REPORTO					1,127,072,361.24	19.16
OTROS VALORES				17,464,140	213,965,606.06	3.64
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					5,882,944,756.90	100.00

CATEGORÍA
IDCP

CALIFICACIÓN
AAAf/S1(mex)

VaR Promedio
0.016%

Límite de VaR
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