

GBMfondos

GBMF3 GBM VALORES DE DEUDA, S.A. DE C.V., F.I.I.D. CARTERA DE VALORES AL 11 ABRIL, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDEF	261203	mxAAA	6,000,000	600,580,242.00	10.03
LF	BONDEF	250619	mxAAA	3,000,000	301,123,323.00	5.03
OTROS TIPO DE VALOR LF - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F				1,612,096	161,017,232.21	2.69
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES						
S	UDIBONO	251204	mxAAA	435,694	344,118,078.80	5.75
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS						
94	BLADEX	23	mxAAA	1,200,000	120,781,764.00	2.02
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO						
OTROS TIPO DE VALOR 93 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO				1,926,125	189,488,192.00	3.17
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
91	ORBIA	22L	AAA(mex)	1,590,000	159,636,260.76	2.67
91	CETELEM	21-3	mxAAA	1,300,000	130,288,013.70	2.18
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS				13,346,647	1,306,309,332.42	21.82
CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL						
95	FEFA	19-3	mxAAA	1,550,000	156,120,394.25	2.61
CERTIFICADOS DE DEPÓSITO						
F	HSBCMX	24003	mxA-1+	1,400,000	140,990,864.00	2.36
CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	241003	mxAAA	30,500,000	289,323,945.50	4.83
BI	CETES	240613	mxAAA	20,000,000	196,241,760.00	3.28
EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS						
D2	BAC847	250216	A-	1,200	121,159,457.70	2.02
TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES						
JI	CABEI	1-22S	mxAAA	1,400,000	141,116,869.60	2.36
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	1,370,000	137,119,624.29	2.29
TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC						
D8	CIT1125	FLOAT	A	62	157,169,664.13	2.63
D8	MSF0925	FLOAT	A-	54	135,949,483.86	2.27
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					4,788,534,502.22	79.98
REPORTO						
2U	CBIC004	310116	mxAAA	645,217	550,163,117.03	9.19
TOTAL REPORTO					550,163,117.03	9.19
OTROS VALORES				39,782,455	648,215,198.90	10.83
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					5,986,912,818.15	100.00

CATEGORÍA IDDIS

CALIFICACIÓN
AAA/S4(mex)

VaR Promedio
0.012%

Límite de VaR
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 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