GBMfondos

GBMM3 GBM FONDO PARA PERSONAS MORALES EXENTAS, S.A. DE C.V., F.I.I.D.
CARTERA DE VALORES AL 18 ABRIL, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDESF	261203	mxAAA	3,000,000	300,949,902.00	8.32
LF	BONDESF	250619	mxAAA	1,507,859	151,679,416.53	4.19
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES						
S	UDIBONO	251204	mxAAA	344,912	271,561,161.21	7.51
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO TRIMESTRAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IQ	BPAG91	240502	mxAAA	750,000	76,834,162.50	2.12
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS						
OTROS TIPO DE VALOR 94 - CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS				1,167,283	117,138,255.29	3.24
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
91	ORBIA	22L	AAA(mex)	919,890	92,565,141.83	2.56
91	GBM	21	HR AA+	800,000	80,062,110.40	2.21
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS				9,150,591	900,441,353.31	24.89
CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL						
95	FEFA	19-3	mxAAA	926,000	93,472,709.63	2.58
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	241003	mxAAA	18,500,000	175,840,539.00	4.86
EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS						
D2	BAC847	250216	A-	800	80,932,262.88	2.24
OTROS TIPO DE VALOR D2 - EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS				798	73,981,688.72	2.05
TITULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC						
D8	CIT1125	FLOAT	A	35	88,932,245.97	2.46
D8	MSF0925	FLOAT	A-	34	85,797,723.46	2.37
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					**2,590,188,672.73**	**71.60**
REPORTO						
LF	BONDESF	250130	mxAAA	7,220,018	725,899,871.11	20.07
TOTAL REPORTO					**725,899,871.11**	**20.07**
OTROS VALORES				27,029,960	**301,617,889.82**	**8.34**
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					**3,617,706,433.66**	**100.00**

CATEGORÍA		
IDDIS		
CALIFICACIÓN	**VaR Promedio**	**Límite de VaR**
AAAf/S4(mex)	0.013%	0.440%

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