

GBMfondos

GBMF3 GBM VALORES DE DEUDA, S.A. DE C.V., F.I.I.D.
CARTERA DE VALORES AL 29 NOVIEMBRE, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDES F	261203	mxAAA	6,000,000	602,532,216.00	9.51
LF	BONDES F	270520	mxAAA	4,000,000	401,191,112.00	6.33
LF	BONDES F	261001	mxAAA	1,500,000	149,787,450.00	2.36
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA						
M	BONOS	260903	mxAAA	1,480,000	144,279,250.40	2.28
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES						
S	UDIBONO	251204	mxAAA	462,832	388,143,595.41	6.12
S	UDIBONO	261203	mxAAA	378,342	301,395,795.67	4.75
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS						
OTROS TIPO DE VALOR 94 - CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS				2,130,000	214,212,437.94	3.38
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO						
OTROS TIPO DE VALOR 93 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO				1,960,070	191,490,067.36	3.02
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
91	ORBIA	22L	AAA(mex)	1,430,000	144,138,889.18	2.27
91	DAIMLER	23	mxAAA	1,300,000	131,166,473.10	2.07
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS				13,248,654	1,286,296,809.44	20.29
CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL						
OTROS TIPO DE VALOR 95 - CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO				2,350,586	229,294,233.27	3.62
CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	250320	mxAAA	15,000,000	145,560,000.00	2.30
TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES						
JI	CABEI	1-22S	mxAAA	1,400,000	140,391,024.20	2.21
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	1,370,000	137,767,279.46	2.17
TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC						
D8	CIT1125	FLOAT	A	62	157,049,921.07	2.48
D8	MSF0925	FLOAT	A-	54	136,277,720.43	2.15
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					4,900,974,274.93	77.31
REPORTO						
LF	BONDES F	290322	mxAAA	4,585,190	457,071,593.97	7.21
2U	CBIC004	310116	mxAAA	393,061	350,298,925.47	5.53
TOTAL REPORTO					807,370,519.44	12.74
OTROS VALORES				36,915,288	630,720,922.90	9.95
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					6,339,065,717.27	100.00

CATEGORÍA IDDIS

CALIFICACIÓN
AAA/S4(mex)

VaR Promedio
0.019%

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