

# GBMfondos

GBMF3 GBM VALORES DE DEUDA, S.A. DE C.V., F.I.I.D.  
CARTERA DE VALORES AL 30 MAYO, 2025

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDES F	270520	mxAAA	6,500,000	649,916,865.00	8.06
LF	BONDES F	261203	mxAAA	6,000,000	600,497,436.00	7.45
OTROS TIPO DE VALOR LF - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F				3,500,000	350,101,577.00	4.34
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES						
S	UDIBONO	251204	mxAAA	915,972	793,109,884.67	9.83
S	UDIBONO	261203	mxAAA	684,614	575,293,246.12	7.13
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS						
OTROS TIPO DE VALOR 94 - CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS				1,750,000	176,008,134.45	2.18
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO						
OTROS TIPO DE VALOR 93 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO				3,932,326	385,271,649.21	4.78
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS				15,198,795	1,446,774,325.34	17.94
CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL						
OTROS TIPO DE VALOR 95 - CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL				2,880,586	287,493,070.46	3.56
EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS						
OTROS TIPO DE VALOR D2 - EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS				1,105	267,636,773.94	3.32
TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES						
OTROS TIPO DE VALOR JI - TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES				3,302,000	332,424,320.05	4.12
TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC						
D8	GSG1126	FLOAT	BBB+	75	189,858,571.58	2.35
OTROS TIPO DE VALOR D8 - TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC				90	226,088,911.81	2.80
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					6,280,474,765.63	77.87
REPORTO						
LF	BONDES F	260226	mxAAA	7,545,397	755,334,785.45	9.37
2U	CBIC002	300117	mxAAA	726,950	700,476,456.53	8.69
TOTAL REPORTO					1,455,811,241.98	18.05
OTROS VALORES				23,804,627	329,101,531.80	4.08
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					8,065,387,539.41	100.00

CATEGORÍA  
IDDIS

CALIFICACIÓN  
AAAf/S4(mex)

VaR Promedio  
0.023%

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