

GBMfondos

GBMPAT GBM FONDO PATRIMONIAL, 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	BONDESF	270520	mxAAA	1,800,000	179,976,978.00	3.46
LF	BONDESF	270422	mxAAA	1,500,000	149,995,540.50	2.89
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA						
M	BONOS	290531	mxAAA	3,000,000	310,862,598.00	5.98
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES						
S	UDIBONO	261203	mxAAA	570,081	479,049,141.62	9.22
S	UDIBONO	251204	mxAAA	540,069	467,627,899.44	9.00
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO						
OTROS TIPO DE VALOR 93 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO				2,806,593	272,770,713.31	5.25
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS				7,095,524	681,415,987.19	13.12
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				2,325,253	232,053,260.90	4.47
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	250626	mxAAA	21,500,000	213,789,657.50	4.12
EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS						
OTROS TIPO DE VALOR D2 - EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS				2,398	219,163,255.95	4.22
TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES						
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	1,030,000	103,905,505.96	2.00
TITULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC						
D8	GSG1126	FLOAT	BBB+	61	154,418,304.89	2.97
OTROS TIPO DE VALOR D8 - TITULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC				3,055	152,724,362.88	2.94
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					3,617,753,206.14	69.64
REPORTO						
LF	BONDESF	260226	mxAAA	8,653,484	866,260,248.53	16.68
BI	CETES	260611	mxAAA	32,592,643	300,214,240.90	5.78
TOTAL REPORTO					1,166,474,489.43	22.45
OTROS VALORES				26,628,236	410,528,858.54	7.90
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					5,194,756,554.11	100.00

CATEGORÍA
IDDIS

CALIFICACIÓN
AAAf/S4(mex)

VaR Promedio
0.036%

Límite de VaR
0.690%

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