

GBMfondos

GBMPAT GBM FONDO PATRIMONIAL, S.A. DE C.V., F.I.I.D.
CARTERA DE VALORES AL 31 OCTUBRE, 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	2,800,000	280,895,048.00	4.03
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA						
M	BONOS	290301	mxAAA	7,350,000	758,325,688.05	10.87
M	BONOS	421113	mxAAA	3,550,000	318,010,629.45	4.56
OTROS TIPO DE VALOR M - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA				1,550,000	153,954,749.70	2.21
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES						
S	UDIBONO	261203	mxAAA	1,073,723	930,134,576.18	13.34
S	UDIBONO	281130	mxAAA	199,725	174,652,313.41	2.50
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS						
OTROS TIPO DE VALOR 94 - CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS				1,248,485	210,017,117.26	3.01
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO						
OTROS TIPO DE VALOR 93 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO				2,352,408	230,264,572.47	3.30
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS				8,426,958	813,562,575.85	11.66
CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL						
OTROS TIPO DE VALOR 95 - CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO				2,970,000	302,551,700.83	4.34
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACION CON IMPUESTO						
BI	CETES	261001	mxAAA	40,000,000	374,377,680.00	5.37
EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS						
OTROS TIPO DE VALOR D2 - EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS				1,698	150,466,222.40	2.16
TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES						
OTROS TIPO DE VALOR J1 - TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES				2,064,000	207,299,752.81	2.97
TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC						
D8	GSG1126	FLOAT	BBB+	94	238,131,403.10	3.41
D8	BOA0527	FLOAT	A-	1,700	170,168,578.21	2.44
OTROS TIPO DE VALOR D8 - TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC				3,062	167,630,430.99	2.40
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					5,480,443,038.71	78.58
REPORTO						
LF	BONDES F	300321	mxAAA	9,059,328	903,785,819.15	12.96
BI	CETES	270318	mxAAA	38,159,198	345,219,934.93	4.95
TOTAL REPORTO					1,249,005,754.08	17.91
OTROS VALORES						
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES				24,215,534	245,183,054.69	3.52

CATEGORÍA IDDIS

CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
AAAf/S4(mex)	0.055%	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 período 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