

gbmfondos

GBMF3 GBM VALORES DE DEUDA, S.A. DE C.V., F.I.I.D.
CARTERA DE VALORES AL 31 DICIEMBRE, 2025

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA						
M	BONOS	290301	mxAAA	7,750,000	805,190,039.75	8.48
M	BONOS	280302	mxAAA	3,500,000	364,215,558.00	3.84
M	BONOS	290531	mxAAA	2,700,000	274,535,397.90	2.89
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES						
S	UDIBONO	261203	mxAAA	1,661,125	1,436,257,422.37	15.13
S	UDIBONO	281130	mxAAA	304,049	263,423,726.68	2.78
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS						
94	BLADEX	23	mxAAA	2,450,000	245,536,795.00	2.59
OTROS TIPO DE VALOR 94 - CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS				1,975,028	415,942,860.34	4.38
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO						
OTROS TIPO DE VALOR 93 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO				2,016,330	199,584,133.07	2.10
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
91	SAKLY	25	AAA(mex)	2,120,000	213,011,907.80	2.24
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS				13,711,617	1,291,359,338.60	13.60
CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL						
OTROS TIPO DE VALOR 95 - CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO				2,910,000	292,471,013.81	3.08
CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	261001	mxAAA	40,000,000	378,643,920.00	3.99
TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES						
OTROS TIPO DE VALOR JI - TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES				4,584,419	459,945,218.35	4.85
TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC						
D8	GSG1126	FLOAT	BBB+	122	308,961,375.70	3.25
OTROS TIPO DE VALOR D8 - TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC				1,908	450,734,798.00	4.75
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					7,399,813,505.37	77.95
REPORTO						
LF	BONDESF	291101	mxAAA	15,069,110	1,496,556,267.10	15.77
TOTAL REPORTO					1,496,556,267.10	15.77
OTROS VALORES				34,501,542	596,265,324.56	6.28
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					9,492,635,097.03	100.00

CATEGORÍA
IDDIS

CALIFICACIÓN
AAAf/S4(mex)

VaR Promedio
0.030%

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