

gbmfondos

GBMF3 GBM VALORES DE DEUDA, S.A. DE C.V., F.I.I.D.
CARTERA DE VALORES AL 22 ENERO, 2026

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	810,211,365.50	8.29
M	BONOS	280302	mxAAA	4,500,000	471,971,529.00	4.83
M	BONOS	290531	mxAAA	3,400,000	347,927,389.00	3.56
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES						
S	UDIBONO	261203	mxAAA	1,661,125	1,441,107,914.02	14.74
S	UDIBONO	281130	mxAAA	304,049	265,794,684.06	2.72
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS						
94	BLADEX	23	mxAAA	2,450,000	246,617,105.35	2.52
OTROS TIPO DE VALOR 94 - CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS				1,975,028	414,356,693.44	4.24
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL						
OTROS TIPO DE VALOR 92 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL				2,939,000	289,452,244.67	2.96
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
91	SAKLY	25	AAA(mex)	2,120,000	212,676,757.00	2.18
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS				15,421,617	1,463,366,336.20	14.97
CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL						
OTROS TIPO DE VALOR 95 - CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO				3,810,000	383,116,334.03	3.92
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	261001	mxAAA	40,000,000	380,677,880.00	3.89
TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES						
OTROS TIPO DE VALOR JI - TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES				4,584,419	460,617,616.69	4.71
TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC						
D8	GSG1126	FLOAT	BBB+	122	308,205,760.93	3.15
D8	MSF0429	ZERO	A-	80	201,426,183.57	2.06
OTROS TIPO DE VALOR D8 - TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC				1,876	370,685,774.63	3.79
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					8,068,211,568.09	82.54
REPORTO						
2U	CBIC002	300117	mxAAA	604,985	600,106,588.95	6.14
LF	BONDESF	261203	mxAAA	5,410,025	542,382,827.72	5.55
TOTAL REPORTO					1,142,489,416.67	11.69
OTROS VALORES				34,648,844	563,812,135.74	5.77
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					9,774,513,120.50	100.00

CATEGORÍA
IDDIS

CALIFICACIÓN
AAAf/S4(mex)

VaR Promedio
0.029%

Limite 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