

gbmfondos

GBMPAT GBM FONDO PATRIMONIAL, S.A. DE C.V., F.I.I.D.
CARTERA DE VALORES AL 30 ENERO, 2026

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	1,800,000	179,911,764.00	2.48
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA						
M	BONOS	290301	mxAAA	7,750,000	815,561,686.50	11.26
M	BONOS	421113	mxAAA	4,350,000	384,561,671.70	5.31
M	BONOS	381118	mxAAA	1,900,000	184,533,720.90	2.55
M	BONOS	280302	mxAAA	1,400,000	147,580,605.20	2.04
OTROS TIPO DE VALOR M - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA				1,900,000	195,342,846.75	2.70
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES						
S	UDIBONO	261203	mxAAA	1,073,723	932,764,160.31	12.88
S	UDIBONO	281130	mxAAA	475,221	416,073,492.64	5.74
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO						
OTROS TIPO DE VALOR 93 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO				1,929,071	190,312,499.04	2.63
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL						
OTROS TIPO DE VALOR 92 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL				2,382,694	235,173,002.39	3.25
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
91	SAKLY	25	AAA(mex)	2,080,000	209,153,719.84	2.89
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS				8,379,998	823,862,915.64	11.37
CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL						
OTROS TIPO DE VALOR 95 - CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO				2,550,000	256,431,173.65	3.54
CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	261001	mxAAA	40,000,000	381,582,280.00	5.27
TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES						
OTROS TIPO DE VALOR JI - TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES				3,414,000	343,300,451.57	4.74
TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC						
D8	GSG1126	FLOAT	BBB+	94	236,360,331.16	3.26
D8	BOA0527	FLOAT	A-	1,700	170,046,138.50	2.35
OTROS TIPO DE VALOR D8 - TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC				3,076	200,169,910.45	2.76
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					6,302,722,370.24	87.00
REPORTO						
BI	CETES	261112	mxAAA	31,528,180	298,238,394.17	4.12
LF	BONDES F	310320	mxAAA	2,957,667	293,340,615.65	4.05
TOTAL REPORTO					591,579,009.82	8.17
OTROS VALORES				26,480,809	349,912,248.97	4.83
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					7,244,213,629.03	100.00

CATEGORÍA
IDDIS

CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Limite de VaR
AAAf/S4(mex)	0.078%	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