

gbmfondos

GBMF3 GBM VALORES DE DEUDA, S.A. DE C.V., F.I.I.D.
CARTERA DE VALORES AL 27 FEBRERO, 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	290531	mxAAA	10,400,000	1,088,832,856.80	11.28
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES						
S	UDIBONO	261203	mxAAA	1,776,109	1,552,936,323.56	16.09
S	UDIBONO	281130	mxAAA	304,049	269,940,786.52	2.80
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS						
94	BLADEX	23	mxAAA	2,450,000	245,573,814.50	2.54
OTROS TIPO DE VALOR 94 - CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS				1,975,028	418,121,385.18	4.33
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL						
OTROS TIPO DE VALOR 92 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL				2,939,000	289,377,133.40	3.00
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
91	SIGMA	26	AAA.mx	2,850,000	285,180,570.30	2.95
91	SAKLY	25	AAA(mex)	2,120,000	213,130,697.76	2.21
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS				15,936,332	1,537,895,662.66	15.93
CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL						
95	PEMEX	14-2	mxAAA	2,800,000	285,261,197.20	2.95
OTROS TIPO DE VALOR 95 - CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO				3,910,000	391,612,569.72	4.06
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	261001	mxAAA	40,000,000	384,004,920.00	3.98
TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES						
OTROS TIPO DE VALOR JI - TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES				4,584,419	460,829,461.44	4.77
TITULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC						
D8	GSG1126	FLOAT	BBB+	122	306,819,659.78	3.18
D8	MSF0429	ZERO	A-	80	201,835,258.61	2.09
OTROS TIPO DE VALOR D8 - TITULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC				1,836	270,309,580.17	2.80
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					8,201,661,877.60	84.96
REPORTO						
2U	CBIC002	300117	mxAAA	495,471	500,270,342.65	5.18
LF	BONDESF	300321	mxAAA	2,724,884	270,760,781.35	2.80
TOTAL REPORTO					771,031,124.00	7.99
OTROS VALORES				35,234,417	681,324,451.86	7.06
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					9,654,017,453.46	100.00

CATEGORÍA
IDDIS

CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Limite de VaR
AAAf/S4(mex)	0.024%	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