

gbmfondos

GBMPAT GBM FONDO PATRIMONIAL, S.A. DE C.V., F.I.I.D.
CARTERA DE VALORES AL 31 MARZO, 2026

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Titulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA						
M	BONOS	290531	mxAAA	11,045,000	1,135,044,483.61	14.87
M	BONOS	421113	mxAAA	3,750,000	321,103,443.75	4.21
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES						
S	UDIBONO	261203	mxAAA	1,073,723	950,070,766.92	12.45
S	UDIBONO	281130	mxAAA	475,221	419,734,642.27	5.50
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL						
OTROS TIPO DE VALOR 92 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL				1,563,000	155,550,839.00	2.04
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
91	SIGMA	26	AAA.mx	2,250,000	224,948,612.25	2.95
91	SAKLY	25	AAA(mex)	2,080,000	209,174,463.68	2.74
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS				9,379,998	917,630,473.51	12.02
CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL						
95	PEMEX	14-2	mxAAA	2,100,000	215,463,460.80	2.82
CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	261001	mxAAA	40,000,000	386,066,240.00	5.06
TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES						
OTROS TIPO DE VALOR JI - TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES				3,769,000	378,838,576.17	4.96
TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC						
D8	GSG1126	FLOAT	BBB+	94	236,396,243.04	3.10
D8	BOA0527	FLOAT	A-	1,700	170,220,932.95	2.23
OTROS TIPO DE VALOR D8 - TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC				3,076	200,670,696.05	2.63
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					5,920,913,874.00	77.57
REPORTO						
LF	BONDESF	270128	mxAAA	6,496,262	649,093,078.20	8.50
BI	CETES	270513	mxAAA	34,515,011	318,461,106.87	4.17
TOTAL REPORTO					967,554,185.07	12.68
OTROS VALORES				28,150,090	744,488,820.81	9.75
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					7,632,956,879.88	100.00

CATEGORÍA IDDIS

CALIFICACIÓN
AAA/S4(mex)

VaR Promedio
0.079%

Límite de VaR
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