

gbmfondos

GBMF3 GBM VALORES DE DEUDA, S.A. DE C.V., F.I.I.D.
CARTERA DE VALORES AL 31 AGOSTO, 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	7,600,795	787,853,260.98	7.69
M	BONOS	300228	mxAAA	2,242,631	235,348,961.02	2.30
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES						
S	UDIBONO	261203	mxAAA	2,075,151	1,846,118,167.47	18.02
S	UDIBONO	281130	mxAAA	439,692	394,929,999.27	3.86
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL						
OTROS TIPO DE VALOR 92 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL				2,281,781	226,364,992.69	2.21
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
91	SAKLY	25	AAA(mex)	2,120,000	212,505,401.64	2.07
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS				17,399,371	1,620,858,690.96	15.82
CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL						
95	PEMEX	14-2	mxAAA	2,940,000	300,783,053.34	2.94
OTROS TIPO DE VALOR 95 - CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO				2,200,000	220,949,921.38	2.16
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	280412	mxAAA	98,367,062	873,391,995.36	8.53
EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS						
OTROS TIPO DE VALOR D2 - EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS				2,584	238,954,519.79	2.33
TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES						
OTROS TIPO DE VALOR JI - TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES				4,994,419	501,373,663.26	4.89
TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC						
D8	GSG1126	FLOAT	BBB+	122	306,680,870.69	2.99
OTROS TIPO DE VALOR D8 - TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC				2,106	590,078,924.02	5.76
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					8,356,192,421.87	81.57
REPORTO						
LF	BONDESF	270318	mxAAA	9,053,214	908,392,330.31	8.87
2U	CBIC004	310116	mxAAA	516,283	500,082,891.87	4.88
TOTAL REPORTO					1,408,475,222.18	13.75
OTROS VALORES				23,819,865	479,954,813.27	4.68
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					10,244,622,457.32	100.00

CATEGORÍA
IDDIS

CALIFICACIÓN
AAAf/S4(mex)

VaR Promedio
0.033%

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