GBMfondos

GBMF3 GBM VALORES DE DEUDA, S.A. DE C.V., F.I.I.D.
CARTERA DE VALORES AL 30 SEPTIEMBRE, 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	788,170,290.14	7.63
M	BONOS	300228	mxAAA	5,722,071	575,417,616.71	5.57
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES						
S	UDIBONO	261203	mxAAA	2,075,151	1,856,235,408.46	17.98
S	UDIBONO	281130	mxAAA	439,692	397,462,145.05	3.85
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS						
OTROS TIPO DE VALOR 94 - CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS				1,756,559	268,821,431.70	2.60
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL						
OTROS TIPO DE VALOR 92 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL				2,281,781	227,558,823.68	2.20
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
91	SAKLY	25	AAA(mex)	2,120,000	212,592,090.56	2.06
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS				18,721,083	1,795,056,543.22	17.39
CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL						
95	CFE	15U	mxAAA	335,425	302,722,772.83	2.93
95	PEMEX	14-2	mxAAA	2,940,000	302,536,263.54	2.93
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	280412	mxAAA	98,367,062	875,849,401.30	8.48
EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS						
OTROS TIPO DE VALOR D2 - EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS				2,709	250,437,686.68	2.43
TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES						
OTROS TIPO DE VALOR JI - TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES				4,994,419	501,701,156.65	4.86
TITULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC						
D8	MSF0429	ZERO	A-	88	221,903,367.76	2.15
OTROS TIPO DE VALOR D8 - TITULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC				2,043	429,081,592.86	4.16
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					**9,005,546,591.14**	**87.22**
REPORTO						
LF	BONDESF	270422	mxAAA	7,028,063	704,540,892.45	6.82
TOTAL REPORTO					**704,540,892.45**	**6.82**
OTROS VALORES				23,802,498	**614,892,038.26**	**5.96**
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					**10,324,979,521.85**	**100.00**

CATEGORÍA
IDDIS

CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
AAAf.mxMRA1.mx	0.042%	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

Lic. Julio Andres Maza Casas