GBMfondos

**GBMF3 GBM VALORES DE DEUDA, S.A. DE C.V., F.I.I.D.**
**CARTERA DE VALORES AL 08 MAYO, 2025**

| Tipo Valor | Emisora | Serie | Calif. / Bursatilidad | Cant. Títulos | Valor Razonable | Participación Porcentual |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **DIRECTO** | | | | | | |
| **BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F** | | | | | | |
| LF | BONDESF | 261203 | mxAAA | 6,000,000 | 601,076,532.00 | 8.39 |
| LF | BONDESF | 270520 | mxAAA | 4,000,000 | 400,315,164.00 | 5.59 |
| LF | BONDESF | 270819 | mxAAA | 1,500,000 | 149,829,696.00 | 2.09 |
| **BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES** | | | | | | |
| S | UDIBONO | 251204 | mxAAA | 915,972 | 785,036,323.35 | 10.95 |
| S | UDIBONO | 261203 | mxAAA | 684,614 | 569,971,982.48 | 7.95 |
| **CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS** | | | | | | |
| OTROS TIPO DE VALOR 94 - CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS | | | | 1,750,000 | 176,164,876.70 | 2.46 |
| **CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO** | | | | | | |
| OTROS TIPO DE VALOR 93 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO | | | | 3,910,501 | 382,259,182.21 | 5.33 |
| **CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS** | | | | | | |
| 91 | ORBIA | 25 | AAA(mex) | 1,450,000 | 146,168,207.00 | 2.04 |
| OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS | | | | 13,834,469 | 1,314,174,118.02 | 18.34 |
| **CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL** | | | | | | |
| 95 | FEFA | 1-25 | mxAAA | 1,460,000 | 146,439,124.20 | 2.04 |
| OTROS TIPO DE VALOR 95 - CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO | | | | 1,420,586 | 143,421,708.78 | 2.00 |
| **EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS** | | | | | | |
| OTROS TIPO DE VALOR D2 - EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS | | | | 769 | 147,018,909.93 | 2.05 |
| **TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES** | | | | | | |
| OTROS TIPO DE VALOR JI - TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES | | | | 3,302,000 | 331,661,203.80 | 4.63 |
| **TITULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC** | | | | | | |
| D8 | CIT1125 | FLOAT | A | 62 | 156,001,229.59 | 2.18 |
| OTROS TIPO DE VALOR D8 - TITULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC | | | | 83 | 209,722,998.26 | 2.93 |
| **TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO** | | | | | **5,659,261,256.32** | **78.97** |
| | | | | | | |
| **REPORTO** | | | | | | |
| 2U | CBIC002 | 300117 | mxAAA | 730,907 | 700,167,337.07 | 9.77 |
| LF | BONDESF | 291101 | mxAAA | 4,765,761 | 474,372,291.18 | 6.62 |
| **TOTAL REPORTO** | | | | | **1,174,539,628.25** | **16.39** |
| | | | | | | |
| **OTROS VALORES** | | | | 23,418,079 | **332,859,329.49** | **4.64** |
| | | | | | | |
| **TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES** | | | | | **7,166,660,214.06** | **100.00** |

| CATEGORÍA |
|---|
| IDDIS |

| CALIFICACIÓN | VaR Promedio | Límite de VaR |
|---|---|---|
| AAAf/S4(mex) | 0.021% | 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