

# GBMfondos

GBMF3 GBM VALORES DE DEUDA, S.A. DE C.V., F.I.I.D.  
CARTERA DE VALORES AL 15 MAYO, 2025

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
<b>DIRECTO</b>						
<b>BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F</b>						
LF	BONDES F	270520	mxAAA	6,500,000	651,775,403.50	8.89
LF	BONDES F	261203	mxAAA	6,000,000	602,172,192.00	8.21
LF	BONDES F	270819	mxAAA	1,500,000	150,097,156.50	2.05
<b>BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES</b>						
S	UDIBONO	251204	mxAAA	915,972	787,392,531.26	10.74
S	UDIBONO	261203	mxAAA	684,614	571,339,132.00	7.79
<b>CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS</b>						
OTROS TIPO DE VALOR 94 - CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS				1,750,000	176,171,114.20	2.40
<b>CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO</b>						
OTROS TIPO DE VALOR 93 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO				3,910,501	382,935,096.43	5.22
<b>CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS</b>						
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS				15,491,795	1,478,550,831.67	20.16
<b>CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL</b>						
95	FEFA	1-25	mxAAA	1,460,000	146,701,687.68	2.00
<b>TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES</b>						
OTROS TIPO DE VALOR JI - TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES				3,302,000	331,338,287.68	4.52
<b>TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC</b>						
D8	CIT1125	FLOAT	A	62	156,306,873.06	2.13
OTROS TIPO DE VALOR D8 - TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC				83	210,115,685.03	2.86
<b>TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO</b>					<b>5,644,895,991.01</b>	<b>76.96</b>
<b>REPORTO</b>						
LF	BONDES F	251204	mxAAA	7,126,898	715,843,679.55	9.76
2U	CBIC002	300117	mxAAA	367,215	350,083,981.69	4.77
<b>TOTAL REPORTO</b>					<b>1,065,927,661.24</b>	<b>14.53</b>
<b>OTROS VALORES</b>				25,215,578	623,739,974.28	8.50
<b>TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES</b>					<b>7,334,563,626.53</b>	<b>100.00</b>

**CATEGORÍA**  
IDDIS

**CALIFICACIÓN**  
AAA/S4(mex)

**VaR Promedio**  
0.022%

**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