

GBMfondos

GBMM3 GBM FONDO PARA PERSONAS MORALES EXENTAS, 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
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDES F	270520	mxAAA	4,200,000	421,147,183.80	8.24
LF	BONDES F	270819	mxAAA	2,500,000	250,161,927.50	4.89
LF	BONDES F	261203	mxAAA	2,000,000	200,724,064.00	3.93
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES						
S	UDIBONO	261203	mxAAA	529,153	441,600,399.22	8.64
S	UDIBONO	251204	mxAAA	494,707	425,262,559.29	8.32
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO						
OTROS TIPO DE VALOR 93 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO				2,598,642	253,166,620.16	4.95
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS				11,051,602	1,065,557,270.17	20.84
CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL						
OTROS TIPO DE VALOR 95 - CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO				2,147,448	207,805,354.75	4.06
TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC						
OTROS TIPO DE VALOR D8 - TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC				91	230,015,771.48	4.50
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					3,495,441,150.37	68.36
REPORTO						
LF	BONDES F	251204	mxAAA	12,120,886	1,217,452,478.43	23.81
TOTAL REPORTO					1,217,452,478.43	23.81
OTROS VALORES						
				25,040,395	400,023,984.01	7.82
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					5,112,917,612.81	100.00

CATEGORÍA
IDDIS

CALIFICACIÓN
AAAf/S4(mex)

VaR Promedio
0.022%

Limite de VaR
0.440%

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