

# GBMfondos

GBMF3 GBM VALORES DE DEUDA, S.A. DE C.V., F.I.I.D.  
CARTERA DE VALORES AL 05 DICIEMBRE, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDES F	261203	mxAAA	6,000,000	598,377,096.00	9.10
LF	BONDES F	270520	mxAAA	4,000,000	398,421,824.00	6.06
LF	BONDES F	270819	mxAAA	1,500,000	150,216,061.50	2.28
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES						
S	UDIBONO	251204	mxAAA	462,832	379,858,960.00	5.78
S	UDIBONO	261203	mxAAA	378,342	297,451,515.25	4.52
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS						
OTROS TIPO DE VALOR 94 - CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS				2,130,000	213,426,873.93	3.25
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO						
OTROS TIPO DE VALOR 93 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO				1,760,070	171,679,812.46	2.61
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL						
OTROS TIPO DE VALOR 92 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL				1,336,214	132,291,982.84	2.01
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
91	ORBIA	22L	AAA(mex)	1,430,000	143,078,106.60	2.18
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS				14,548,654	1,417,688,454.92	21.56
CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL						
OTROS TIPO DE VALOR 95 - CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL				2,350,586	229,443,116.65	3.49
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	250320	mxAAA	15,000,000	145,755,780.00	2.22
TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES						
JI	CABEI	1-22S	mxAAA	1,400,000	140,558,145.00	2.14
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	1,370,000	137,930,553.32	2.10
TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC						
D8	CIT1125	FLOAT	A	62	157,246,729.49	2.39
D8	MSF0925	FLOAT	A-	54	135,228,380.76	2.06
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					4,848,653,392.72	73.74
REPORTO						
2U	CBIC002	300117	mxAAA	746,621	700,191,672.94	10.65
LF	BONDES F	290419	mxAAA	5,074,242	503,642,913.83	7.66
TOTAL REPORTO					1,203,834,586.77	18.31
OTROS VALORES				36,427,125	522,629,944.11	7.95
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					6,575,117,923.60	100.00

CATEGORÍA  
IDDIS

CALIFICACIÓN  
AAAf/S4(mex)

VaR Promedio  
0.019%

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