

GBMfondos

GBMGUB GBM FONDO DE INSTRUMENTOS GUBERNAMENTALES, S.A. DE C.V. Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda
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	270819	mxAAA	2,500,000	250,161,927.50	17.96
LF	BONDES F	270520	mxAAA	1,500,000	150,409,708.50	10.80
LF	BONDES F	270422	mxAAA	1,499,701	150,398,390.61	10.80
LF	BONDES F	261203	mxAAA	1,000,000	100,362,032.00	7.21
LF	BONDES F	270114	mxAAA	1,000,000	99,971,214.00	7.18
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES						
S	UDIBONO	251204	mxAAA	243,817	209,591,215.44	15.05
S	UDIBONO	261203	mxAAA	70,190	58,576,502.49	4.21
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	250626	mxAAA	7,500,000	74,297,205.00	5.34
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					1,093,768,195.54	78.55
REPORTO						
LF	BONDES F	251204	mxAAA	2,972,675	298,583,003.44	21.44
TOTAL REPORTO					298,583,003.44	21.44
OTROS VALORES				8,451	164,818.16	0.01
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					1,392,516,017.14	100.00

CATEGORÍA IDDISGUB

CALIFICACIÓN
AAA/S2(mex)

VaR Promedio
0.010%

Limite de VaR
0.290%

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