

gbmfondos

GBMGUBL GBM FONDO GUBERNAMENTAL DE LIQUIDEZ INMEDIATA, S. A. DE C. V., F.I.I.D.
CARTERA DE VALORES AL 24 ABRIL, 2025

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D						
LD	BONDESD	251211	mxAAA	5,000,000	502,486,730.00	4.46
LD	BONDESD	260212	mxAAA	5,000,000	501,524,995.00	4.46
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDESF	261001	mxAAA	18,500,000	1,850,883,356.50	16.45
LF	BONDESF	270114	mxAAA	15,116,957	1,513,802,051.44	13.45
LF	BONDESF	270422	mxAAA	8,500,000	847,784,186.00	7.53
LF	BONDESF	250522	mxAAA	5,000,000	500,099,030.00	4.44
LF	BONDESF	261231	mxAAA	5,000,000	498,935,460.00	4.43
LF	BONDESF	261203	mxAAA	3,250,000	324,370,286.50	2.88
LF	BONDESF	270819	mxAAA	2,483,388	248,846,630.50	2.21
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					6,788,732,725.94	60.32
REPORTO						
LF	BONDESF	270318	mxAAA	28,471,188	2,840,710,723.35	25.24
IS	BPA182	270930	mxAAA	5,621,249	565,076,745.79	5.02
IS	BPA182	310327	mxAAA	5,266,060	527,005,244.15	4.68
IS	BPA182	270401	mxAAA	4,258,320	427,929,127.25	3.80
TOTAL REPORTO					4,360,721,840.54	38.75
OTROS VALORES				1,044,960	104,789,067.99	0.93
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					11,254,243,634.47	100.00

CATEGORÍA
IDCPGUB

CALIFICACIÓN
AAA/S1(mex)

VaR Promedio
0.001%

Límite de VaR
0.125%

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