

# GBMfondos

GBMGUBL GBM FONDO GUBERNAMENTAL DE LIQUIDEZ INMEDIATA, 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 D</b>						
LD	BONDES D	251211	mxAAA	5,000,000	501,762,875.00	4.62
LD	BONDES D	260212	mxAAA	5,000,000	500,688,320.00	4.61
<b>BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F</b>						
LF	BONDES F	270422	mxAAA	23,400,000	2,346,682,665.60	21.58
LF	BONDES F	270114	mxAAA	15,116,957	1,511,260,543.28	13.90
LF	BONDES F	261001	mxAAA	9,500,000	948,737,089.00	8.73
LF	BONDES F	250522	mxAAA	5,000,000	502,759,415.00	4.62
LF	BONDES F	261231	mxAAA	5,000,000	501,651,255.00	4.61
LF	BONDES F	261203	mxAAA	3,250,000	326,176,604.00	3.00
LF	BONDES F	270520	mxAAA	3,000,000	300,819,417.00	2.77
LF	BONDES F	270819	mxAAA	2,483,388	248,499,651.52	2.29
<b>TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO</b>					<b>7,689,037,835.40</b>	<b>70.72</b>
<b>REPORTO</b>						
LF	BONDES F	261231	mxAAA	23,561,031	2,360,589,955.74	21.71
IQ	BPAG91	250904	mxAAA	6,665,373	679,028,418.05	6.25
<b>TOTAL REPORTO</b>					<b>3,039,618,373.79</b>	<b>27.96</b>
<b>OTROS VALORES</b>				1,420,101	143,472,236.58	1.32
<b>TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES</b>					<b>10,872,128,445.77</b>	<b>100.00</b>

**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