

# GBMfondos

GBMGUBL GBM FONDO GUBERNAMENTAL DE LIQUIDEZ INMEDIATA, S. A. DE C. V., F.I.I.D.  
CARTERA DE VALORES AL 31 MARZO, 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     | 503,116,145.00    | 4.48                     |
| LD                                                | BONDESD | 260212 | mxAAA                 | 5,000,000     | 502,106,410.00    | 4.47                     |
| BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F |         |        |                       |               |                   |                          |
| LF                                                | BONDESF | 261001 | mxAAA                 | 18,500,000    | 1,852,277,720.00  | 16.49                    |
| LF                                                | BONDESF | 270114 | mxAAA                 | 15,116,957    | 1,515,510,237.34  | 13.49                    |
| LF                                                | BONDESF | 270422 | mxAAA                 | 5,500,000     | 549,049,996.00    | 4.89                     |
| LF                                                | BONDESF | 250522 | mxAAA                 | 5,000,000     | 500,582,505.00    | 4.46                     |
| LF                                                | BONDESF | 261231 | mxAAA                 | 5,000,000     | 499,399,140.00    | 4.45                     |
| LF                                                | BONDESF | 250424 | mxAAA                 | 4,000,000     | 400,486,368.00    | 3.56                     |
| LF                                                | BONDESF | 261203 | mxAAA                 | 3,250,000     | 324,672,611.25    | 2.89                     |
| LF                                                | BONDESF | 270819 | mxAAA                 | 2,483,388     | 249,148,843.91    | 2.22                     |
| TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO                      |         |        |                       |               | 6,896,349,976.50  | 61.39                    |
| REPORTO                                           |         |        |                       |               |                   |                          |
| IQ                                                | BPAG91  | 270107 | mxAAA                 | 9,821,023     | 1,003,251,490.67  | 8.93                     |
| LF                                                | BONDESF | 280615 | mxAAA                 | 10,081,880    | 1,003,204,453.51  | 8.93                     |
| LF                                                | BONDESF | 290322 | mxAAA                 | 10,085,992    | 1,003,155,305.17  | 8.93                     |
| LF                                                | BONDESF | 271202 | mxAAA                 | 8,141,414     | 811,153,621.38    | 7.22                     |
| LD                                                | BONDESD | 260212 | mxAAA                 | 5,160,588     | 517,470,739.58    | 4.61                     |
| TOTAL REPORTO                                     |         |        |                       |               | 4,338,235,610.31  | 38.62                    |
| TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES                   |         |        |                       |               | 11,234,585,586.81 | 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

Lic. Julio Andres Maza Casas