

GBMfondos

GBMGUBL GBM FONDO GUBERNAMENTAL DE LIQUIDEZ INMEDIATA, S. A. DE C. V., F.I.I.D.
CARTERA DE VALORES AL 30 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	260212	mxAAA	5,000,000	502,432,795.00	4.37
LD	BONDESD	251211	mxAAA	5,000,000	499,988,175.00	4.35
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDESF	261001	mxAAA	18,500,000	1,854,186,661.00	16.12
LF	BONDESF	270114	mxAAA	15,116,957	1,516,473,777.07	13.18
LF	BONDESF	270422	mxAAA	8,500,000	849,303,025.50	7.38
LF	BONDESF	250522	mxAAA	5,000,000	500,986,075.00	4.35
LF	BONDESF	261231	mxAAA	5,000,000	499,828,685.00	4.34
LF	BONDESF	261203	mxAAA	3,250,000	324,994,471.75	2.82
LF	BONDESF	270819	mxAAA	2,483,388	247,609,726.95	2.15
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					6,795,803,392.27	59.07
REPORTO						
LF	BONDESF	270617	mxAAA	19,368,394	1,932,361,145.21	16.80
LF	BONDESF	280127	mxAAA	8,198,102	818,053,567.14	7.11
BI	CETES	261001	mxAAA	56,634,637	504,197,820.04	4.38
IM	BPAG28	270805	mxAAA	5,000,000	499,715,646.69	4.34
IM	BPAG28	261105	mxAAA	5,000,000	499,628,237.62	4.34
TOTAL REPORTO					4,253,956,416.70	36.97
OTROS VALORES				25,245,041	455,393,403.12	3.96
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					11,505,153,212.09	100.00

CATEGORÍA
IDCPGUB

CALIFICACIÓN
AAAf/S1(mex)

VaR Promedio
0.001%

Limite 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