

gbmfondos

MPAGORF Mercado Fondo, S.A. de C.V. Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda
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	BONDES D	260806	mxAAA	10,000,000	1,002,416,480.00	5.33
LD	BONDES D	251016	mxAAA	6,500,000	650,076,485.50	3.46
LD	BONDES D	251211	mxAAA	3,820,000	381,990,965.70	2.03
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDES F	261001	mxAAA	11,801,297	1,182,800,404.32	6.29
LF	BONDES F	270114	mxAAA	11,198,952	1,123,434,897.55	5.97
LF	BONDES F	261231	mxAAA	11,127,185	1,112,337,249.26	5.92
LF	BONDES F	270225	mxAAA	5,000,000	499,724,980.00	2.66
LF	BONDES F	270401	mxAAA	5,000,000	498,896,385.00	2.65
OTROS TIPO DE VALOR LF - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F				8,500,000	852,027,948.50	4.53
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS						
94	BSMX	22-3	AAA.mx	4,500,000	452,004,669.00	2.40
OTROS TIPO DE VALOR 94 - CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS				10,581,421	1,062,192,477.83	5.65
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE BANCA DE DESARROLLO						
OTROS TIPO DE VALOR CD - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE BANCA DE DESARROLLO				8,903,245	892,830,438.78	4.75
CERTIFICADOS DE DEPÓSITO						
F	HSBCMX	24012	mxA-1+	5,500,000	552,969,395.00	2.94
F	CITIMX	25002	mxA-1+	4,000,000	401,039,040.00	2.13
TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES						
OTROS TIPO DE VALOR JI - TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES				3,862,543	388,420,000.52	2.07
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					11,053,161,816.96	58.78
REPORTO						
LF	BONDES F	261231	mxAAA	24,756,377	2,471,429,220.65	13.14
LF	BONDES F	270225	mxAAA	10,000,000	998,002,733.11	5.31
LF	BONDES F	261008	mxAAA	6,615,103	660,961,978.47	3.51
M	BONOS	300228	mxAAA	6,346,994	635,648,078.03	3.38
IS	BPA182	310327	mxAAA	6,071,748	608,734,925.19	3.24
IM	BPAG28	270506	mxAAA	5,000,000	500,928,368.13	2.66
IM	BPAG28	260806	mxAAA	5,000,000	500,836,416.77	2.66
TOTAL REPORTO					6,376,541,720.35	33.91
OTROS VALORES				11,883,249	1,374,613,731.61	7.31
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					18,804,317,268.92	100.00

CATEGORÍA
IDCP

CALIFICACIÓN
AAA/S1(mex)

VaR Promedio
0.009%

Límite de VaR
0.180%

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