

GBMfondos

GBMGUBL GBM FONDO GUBERNAMENTAL DE LIQUIDEZ INMEDIATA, S. A. DE C. V., F.I.I.D.
CARTERA DE VALORES AL 28 JUNIO, 2024

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	502,895,460.00	5.44
LD	BONDESD	251211	mxAAA	5,000,000	499,811,825.00	5.40
LD	BONDESD	251016	mxAAA	2,500,000	249,954,555.00	2.70
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDES F	261001	mxAAA	10,000,000	1,002,136,300.00	10.84
LF	BONDES F	260226	mxAAA	7,500,000	751,142,767.50	8.12
LF	BONDES F	250522	mxAAA	5,000,000	501,292,710.00	5.42
LF	BONDES F	261231	mxAAA	5,000,000	499,789,690.00	5.40
LF	BONDES F	250424	mxAAA	4,000,000	401,099,556.00	4.34
LF	BONDES F	250227	mxAAA	3,675,000	368,557,635.60	3.99
LF	BONDES F	250724	mxAAA	3,000,000	300,061,728.00	3.24
LF	BONDES F	261203	mxAAA	2,000,000	199,948,994.00	2.16
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA						
M	BONOS	240905	mxAAA	6,000,000	611,921,838.00	6.62
M	BONOS	241205	mxAAA	4,500,000	450,851,301.00	4.88
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					6,339,464,360.10	68.55
REPORTO						
LD	BONDESD	250220	mxAAA	20,146,543	2,022,729,323.19	21.87
IM	BPAG28	261105	mxAAA	4,116,627	411,405,294.44	4.45
TOTAL REPORTO					2,434,134,617.63	26.32
OTROS VALORES				4,717,672	473,719,176.16	5.12
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					9,247,318,153.89	100.00

CATEGORÍA
IDCPGUB

CALIFICACIÓN
AAA/i/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