

# GBMfondos

GBMGUB GBM FONDO DE INSTRUMENTOS GUBERNAMENTALES, S.A. DE C.V. Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda  
CARTERA DE VALORES AL 18 JULIO, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
<b>DIRECTO</b>						
<b>BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F</b>						
LF	BONDESF	261001	mxAAA	2,500,000	249,768,247.50	21.59
LF	BONDESF	261203	mxAAA	1,000,000	99,668,033.00	8.62
LF	BONDESF	270422	mxAAA	999,701	99,530,600.45	8.60
<b>BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES</b>						
S	UDIBONO	251204	mxAAA	164,805	131,816,927.65	11.40
<b>CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO</b>						
BI	CETES	241226	mxAAA	35,000,000	333,333,595.00	28.82
BI	CETES	250626	mxAAA	7,500,000	67,701,000.00	5.85
BI	CETES	241114	mxAAA	4,000,000	38,580,056.00	3.34
<b>TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO</b>					<b>1,020,398,459.60</b>	<b>88.22</b>
<b>REPORTO</b>						
LF	BONDESF	250424	mxAAA	1,363,237	136,154,555.29	11.77
<b>TOTAL REPORTO</b>					<b>136,154,555.29</b>	<b>11.77</b>
<b>OTROS VALORES</b>				8,023	<b>144,243.91</b>	<b>0.01</b>
<b>TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES</b>					<b>1,156,697,258.80</b>	<b>100.00</b>

**CATEGORÍA**  
IDDISGUB

**CALIFICACIÓN**  
AAAf/S2(mex)

**VaR Promedio**  
0.014%

**Limite de VaR**  
0.290%

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