

GBMfondos

GBMGUBL GBM FONDO GUBERNAMENTAL DE LIQUIDEZ INMEDIATA, S. A. DE C. V., F.I.I.D.
CARTERA DE VALORES AL 18 JULIO, 2024

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	502,606,150.00	5.22
LD	BONDESD	260212	mxAAA	5,000,000	501,384,755.00	5.20
LD	BONDESD	251016	mxAAA	2,500,000	251,351,620.00	2.61
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDES F	261001	mxAAA	16,000,000	1,598,516,784.00	16.59
LF	BONDES F	250522	mxAAA	5,000,000	499,781,070.00	5.19
LF	BONDES F	261231	mxAAA	5,000,000	498,289,370.00	5.17
LF	BONDES F	260226	mxAAA	4,659,343	465,239,531.39	4.83
LF	BONDES F	250424	mxAAA	4,000,000	399,888,096.00	4.15
LF	BONDES F	250227	mxAAA	3,675,000	367,447,726.80	3.81
LF	BONDES F	250724	mxAAA	3,000,000	301,753,731.00	3.13
LF	BONDES F	261203	mxAAA	2,000,000	199,336,066.00	2.07
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA						
M	BONOS	240905	mxAAA	6,000,000	615,209,862.00	6.38
M	BONOS	241205	mxAAA	3,500,000	352,483,957.00	3.66
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					6,553,288,719.19	68.01
REPORTO						
IQ	BPAG91	250430	mxAAA	12,461,399	1,275,355,379.42	13.24
LF	BONDES F	261231	mxAAA	8,170,224	812,893,885.96	8.44
LD	BONDESD	250220	mxAAA	6,840,411	684,763,500.42	7.11
TOTAL REPORTO					2,773,012,765.80	28.78
OTROS VALORES				12,134,844	309,822,739.96	3.22
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					9,636,124,224.95	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