

GBMfondos

GBMGUBL GBM FONDO GUBERNAMENTAL DE LIQUIDEZ INMEDIATA, S. A. DE C. V., F.I.I.D. CARTERA DE VALORES AL 30 ABRIL, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D						
LD	BONDES	251211	mxAAA	5,000,000	503,180,860.00	6.15
LD	BONDES	240530	mxAAA	2,989,990	301,551,297.32	3.69
LD	BONDES	251016	mxAAA	2,500,000	251,699,425.00	3.08
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDES	260226	mxAAA	9,000,000	900,010,701.00	11.00
LF	BONDES	250522	mxAAA	5,000,000	500,528,780.00	6.12
LF	BONDES	250424	mxAAA	4,000,000	400,556,492.00	4.89
LF	BONDES	250227	mxAAA	3,675,000	368,045,145.83	4.50
LF	BONDES	250724	mxAAA	3,000,000	302,210,775.00	3.69
LF	BONDES	250327	mxAAA	2,250,000	225,334,428.75	2.75
LF	BONDES	261203	mxAAA	2,000,000	199,665,266.00	2.44
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					3,952,783,170.90	48.30
REPORTO						
LD	BONDES	260212	mxAAA	26,278,774	2,633,056,112.18	32.18
LF	BONDES	260226	mxAAA	11,712,124	1,169,278,764.90	14.29
IQ	BPAG91	250430	mxAAA	2,659,994	273,384,797.65	3.34
TOTAL REPORTO					4,075,719,674.73	49.81
OTROS VALORES				1,538,133	154,762,643.76	1.89
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					8,183,265,489.39	100.00

CATEGORÍA IDCPGUB

CALIFICACIÓN
AAAf/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