

GBMfondos

GBMGUB GBM FONDO DE INSTRUMENTOS GUBERNAMENTALES, S.A. DE C.V. Fondo de Inversión en Instrumentos de Deuda CARTERA DE VALORES AL 25 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	2,000,000	200,897,892.00	14.05
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDES	260226	mxAAA	3,000,000	299,417,238.00	20.95
LF	BONDES	260108	mxAAA	1,000,500	100,519,727.75	7.03
LF	BONDES	251002	mxAAA	1,000,000	100,080,044.00	7.00
LF	BONDES	261203	mxAAA	1,000,000	99,646,911.00	6.97
LF	BONDES	250227	mxAAA	500,000	49,981,766.50	3.50
LF	BONDES	250619	mxAAA	300,000	29,975,284.50	2.10
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES						
S	UDIBONO	251204	mxAAA	164,805	130,802,746.35	9.15
BONOS DE PROTECCIÓN AL AHORRO CON PAGO TRIMESTRAL DE INTERÉS Y TASA DE INTERÉS DE REFERENCIA ADICIONAL						
IQ	BPAG91	240502	mxAAA	1,000,000	102,664,709.00	7.18
CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	241003	mxAAA	7,500,000	71,428,665.00	5.00
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					1,185,414,984.10	82.92
REPORTO						
LF	BONDES	250227	mxAAA	2,443,379	243,982,116.81	17.07
TOTAL REPORTO					243,982,116.81	17.07
OTROS VALORES				7,984	137,433.38	0.01
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					1,429,534,534.29	100.00

CATEGORÍA IDDISGUB

CALIFICACIÓN
AAAf/S2(mex)

VaR Promedio
0.011%

Límite 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