

GBMfondos

GBMGUBL GBM FONDO GUBERNAMENTAL DE LIQUIDEZ INMEDIATA, S. A. DE C. V., F.I.I.D.
CARTERA DE VALORES AL 30 SEPTIEMBRE, 2026

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDES F	270909	mxAAA	17,500,000	1,755,532,065.00	9.30
LF	BONDES F	280330	mxAAA	15,000,000	1,501,211,745.00	7.95
LF	BONDES F	270923	mxAAA	14,488,368	1,449,703,334.80	7.68
LF	BONDES F	280127	mxAAA	10,993,503	1,102,087,836.16	5.84
LF	BONDES F	261203	mxAAA	10,706,811	1,074,626,891.76	5.69
LF	BONDES F	261231	mxAAA	9,000,000	903,276,711.00	4.78
LF	BONDES F	280224	mxAAA	9,000,000	902,059,470.00	4.78
LF	BONDES F	261022	mxAAA	5,986,705	599,408,038.11	3.17
LF	BONDES F	270930	mxAAA	5,000,000	502,187,490.00	2.66
LF	BONDES F	271202	mxAAA	5,000,000	501,375,705.00	2.66
LF	BONDES F	280831	mxAAA	5,000,000	501,160,040.00	2.65
LF	BONDES F	280210	mxAAA	4,000,000	399,947,952.00	2.12
OTROS TIPO DE VALOR LF - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F				8,000,000	801,359,039.00	4.24
CERTIFICADOS DE LA TESORERIA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	270121	mxAAA	149,475,378	1,464,054,825.82	7.75
BI	CETES	270204	mxAAA	50,000,000	488,509,750.00	2.59
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					13,946,500,893.65	73.86
REPORTO						
LF	BONDES F	350419	mxAAA	28,344,070	2,796,966,008.26	14.81
IS	BPA182	330407	mxAAA	9,833,330	1,003,730,633.25	5.32
IS	BPA182	320324	mxAAA	5,686,510	584,683,393.24	3.10
TOTAL REPORTO					4,385,380,034.75	23.23
OTROS VALORES				37,013,831	550,036,654.10	2.91
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					18,881,917,582.50	100.00

CATEGORÍA
IDCPGUB

CALIFICACIÓN
AAAf.mxMRA1.mx

VaR Promedio
0.002%

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