

**GBMF2 GBM FC
CARTERA**

Tipo Valor	Emisora	Serie
------------	---------	-------

DIRECTO

BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES D

LD	BONDESD	260212
----	---------	--------

BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F

LF	BONDESF	270923
----	---------	--------

LF	BONDESF	260226
----	---------	--------

LF	BONDESF	270128
----	---------	--------

LF	BONDESF	270909
----	---------	--------

LF	BONDESF	270520
----	---------	--------

OTROS TIPO DE VALOR LF - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDI

CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS

94	BLADEX	23
----	--------	----

94	BSMX	19-2
----	------	------

OTROS TIPO DE VALOR 94 - CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS

CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS

91	SAKLY	25
----	-------	----

OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS

CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIE

95	FNCOT	23S
----	-------	-----

OTROS TIPO DE VALOR 95 - CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O

TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES

JI	CABEI	1-24S
----	-------	-------

OTROS TIPO DE VALOR JI - TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTI

TITULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC

D8	GSG1126	FLOAT
----	---------	-------

D8	BOA0527	FLOAT
----	---------	-------

TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO

REPORTO

IM	BPAG28	270805
----	--------	--------

LF	BONDESF	261231
----	---------	--------

2U	CBIC004	310116
----	---------	--------

IQ	BPAG91	280907
----	--------	--------

TOTAL REPORTO

OTROS VALORES

TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES

CALIFICACIÓN

AAAf/S1(mex)

Para llevar a cabo la estimación del Valor en Riesgo (VaR) de mercado para las Fondos de
siguiendo los criterios metodológicos ap
El método utilizado para la estimación del VaR es el

- El n
- El horizonte tempor

GBMfondos

FONDO DE CORTO PLAZO, S.A. DE C.V., F.I.I.D.
VALORES AL 31 DICIEMBRE, 2025

Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable
mxAAA	2,332,924	233,968,220.09
mxAAA	5,627,011	562,845,528.49
mxAAA	3,000,000	300,090,327.00
mxAAA	3,000,000	299,867,280.00
mxAAA	3,000,000	299,323,896.00
mxAAA	2,000,000	199,714,098.00
ES F	2,000,000	200,335,464.00
mxAAA	2,352,651	235,780,565.83
AAA.mx	1,880,000	193,104,527.12
	3,250,000	326,278,129.80
AAA(mex)	2,500,000	251,193,287.50
	7,829,709	723,215,989.54
ERNO FEDERAL		
AAA.mx	2,300,000	230,454,751.40
INSTITUCIONES DEL GOBIERNO F	2,402,717	241,222,759.59
mxAAA	1,820,400	182,968,234.70
LATERALES	2,100,000	210,717,727.50
BBB+	109	276,039,261.90
A-	2,500	249,867,662.03
		5,216,987,710.49
mxAAA	12,944,748	1,293,568,491.61
mxAAA	10,022,386	1,000,405,462.17
mxAAA	440,832	420,159,811.47
mxAAA	2,033,165	203,444,651.30

2,917,578,416.55

21,150,582

477,505,640.38

8,612,071,767.42

CATEGORÍA

IDCP

VaR Promedio

0.003%

Límite de VaR

0.197%

Inversión administrados por Operadora GBM, se acordó con la empresa Valor de Mercado (Valmer) q
robados por la Unidad de Administración Integral de riesgos de la Operadora.

conocido como simulación histórica, con los parámetros que se presentan a continuación:

- Un periodo de muestra de un año
- ivel de confianza para el VaR fijado al 95%
al para el que se estime la posible minusvalía será de 1 día

Participación Porcentual

2.72

6.54

3.48

3.48

3.48

2.32

2.33

2.74

2.24

3.79

2.92

8.40

2.68

2.80

2.12

2.45

3.21

2.90

60.58

15.02

11.62

4.88

2.36

33.88

5.54

100.00

ue sea ella quien lo realice,