

**GBMF2 GBM FO
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 GOBIERNO

95 FNCOT 23S

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

TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES

JI CABEI 1-24S

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

TÍTULOS 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

INDO DE CORTO PLAZO, S.A. DE C.V., F.I.I.D. DE 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
ESTRUCTURA 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) que se robarados 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
- Nivel de confianza para el VaR fijado al 95%
- Tiempo para el que se estime la posible minusvalía será de 1 día

Lic. Julio Andres Maza Casas

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,