

**GBMF2 GBM FO
CARTEI**

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 270909

LF BONDESF 260226

LF BONDESF 270128

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 CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL

OTROS TIPO DE VALOR 92 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO GUBERNAI

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

TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC

D8 GSG1126 FLOAT

D8 BOA0527 FLOAT

OTROS TIPO DE VALOR D8 - TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC

TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO

REPORTO

LF BONDESF 261001

2U	CBIC002	300117
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.
 RA DE VALORES AL 22 ENERO, 2026

Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable
mxAAA	2,332,924	233,648,936.11
mxAAA	5,627,011	562,103,179.44
mxAAA	4,401,300	440,986,598.61
mxAAA	3,000,000	301,333,689.00
mxAAA	3,000,000	301,112,778.00
mxAAA	2,000,000	200,588,516.00
ES F	2,000,000	200,072,382.00
mxAAA	2,352,651	236,817,950.82
AAA.mx	1,880,000	193,834,636.40
	3,250,000	326,361,604.64
MENTAL	2,616,316	258,866,036.04
AAA(mex)	2,500,000	250,798,062.50
	11,300,715	1,070,573,875.29
ERNO FEDERAL		
AAA.mx	2,300,000	231,470,461.30
INSTITUCIONES DEL GOBIERNO F	2,402,717	241,576,218.00
mxAAA	1,820,400	182,777,454.96
LATERALES	2,100,000	210,910,702.10
BBB+	109	275,364,163.45
A-	2,500	249,472,265.27
	79	198,741,041.70
		6,167,410,551.63
mxAAA	9,966,097	995,194,537.54

mxAAA	504,154	500,088,658.80
mxAAA	4,554,759	457,767,478.64
		1,953,050,674.98
	20,229,525	238,775,702.85
		8,359,236,929.46

CATEGORÍA

IDCP

VaR Promedio

0.002%

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

2.80

6.72

5.28

3.60

3.60

2.40

2.39

2.83

2.32

3.90

3.10

3.00

12.81

2.77

2.89

2.19

2.52

3.29

2.98

2.38

73.78

11.91

5.98

5.48

23.36

2.86

100.00

ue sea ella quien lo realice,