

**GBMF2 GBM FO  
CARTEI**

<b>Tipo Valor</b>	<b>Emisora</b>	<b>Serie</b>
-------------------	----------------	--------------

**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 GUBERNAL**

**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

**OTROS TIPO DE VALOR D8 - TITULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC**

**TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO**

**REPORTO**

LF BONDESF 261001

2U CBIC002  
IQ BPAG91

300117  
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

## INDICE DE CORTO PLAZO, S.A. DE C.V., F.I.I.D. CARTA 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
<b>ESTADO FEDERAL</b>		
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
		<b>6,167,410,551.63</b>
mxAAA	9,966,097	995,194,537.54

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

### 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) que fueron 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

---

Lic. Julio Andres Maza Casas

## 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,