

**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
----	-------	-----

95	FEFA	21-2
----	------	------

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

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

2U	CBIC002	300117
----	---------	--------

LF	BONDESF	280615
2U	CBIC002	300117
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 30 ENERO, 2026

Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable
mxAAA	2,332,924	234,159,099.93
mxAAA	5,627,011	563,383,628.30
mxAAA	4,401,300	439,489,857.32
mxAAA	3,000,000	300,280,608.00
mxAAA	3,000,000	300,086,901.00
mxAAA	2,000,000	199,901,960.00
ES F	2,000,000	200,533,289.00
mxAAA	2,352,651	235,929,893.30
AAA.mx	1,880,000	194,326,025.16
	3,250,000	325,575,037.91
MENTAL	2,235,376	220,951,151.74
AAA(mex)	2,500,000	251,386,682.50
	10,940,715	1,066,357,383.29
ERNO FEDERAL		
AAA.mx	2,300,000	230,627,642.40
mxAAA	1,750,000	175,334,134.50
mxAAA	1,820,400	183,259,034.50
LATERALES	2,100,000	211,132,105.80
BBB+	109	274,077,405.28
A-	2,500	250,067,850.73
		5,856,859,690.66
mxAAA	5,009,329	500,398,801.44
mxAAA	503,846	500,362,721.29

mxAAA	3,663,487	365,157,418.72
mxAAA	352,692	350,253,706.29
		1,716,172,647.74
	21,900,729	613,884,372.05
		8,186,916,710.45

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

2.86

6.88

5.37

3.67

3.67

2.44

2.45

2.88

2.37

3.98

2.70

3.07

13.03

2.82

2.14

2.24

2.58

3.35

3.05

71.54

6.11

6.11

4.46

4.28

20.96

7.50

100.00

ue sea ella quien lo realice,