

**GBMF2 GBM FO
CARTER**

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

DIRECTO

BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F

LF	BONDES F	270923
LF	BONDES F	270909
LF	BONDES F	280210
LF	BONDES F	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 GUBERNAM

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

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	280803
2U	CBIC002	300117
LF	BONDES F	261231

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.
A DE VALORES AL 27 FEBRERO, 2026

Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable
mxAAA	5,627,011	563,485,944.24
mxAAA	4,401,300	439,572,839.43
mxAAA	2,000,000	200,093,220.00
mxAAA	2,000,000	199,944,082.00
ES F	2,000,000	200,550,702.00
mxAAA	2,352,651	235,816,114.39
AAA.mx	1,880,000	195,410,969.40
	3,430,000	343,546,512.24
MENTAL	1,929,060	190,174,784.77
AAA(mex)	2,500,000	251,333,370.00
	12,290,573	1,200,950,371.34
ERNO FEDERAL		
AAA.mx	2,300,000	230,551,666.50
mxAAA	1,750,000	175,265,475.00
INSTITUCIONES DEL GOBIERNO F	1,962,717	198,535,305.93
mxAAA	1,820,400	183,199,900.63
LATERALES	2,100,000	211,087,683.10
BBB+	109	274,125,761.61
A-	2,500	250,052,783.73
		5,543,697,486.31
mxAAA	11,836,129	1,181,048,923.98
mxAAA	495,471	500,270,342.65
mxAAA	3,966,718	396,234,233.77
		2,077,553,500.40

21,459,743

660,341,683.06

8,281,592,669.77

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

Lic. Julio Andres Maza Casas

Participación Porcentual

6.80

5.31

2.42

2.41

2.42

2.85

2.36

4.15

2.30

3.03

14.50

2.78

2.12

2.40

2.21

2.55

3.31

3.02

66.94

14.26

6.04

4.78

25.09

7.97

100.00

ue sea ella quien lo realice,