

# GBMfondos

GBMF2 GBM FONDO DE CORTO PLAZO, S.A. DE C.V., F.I.I.D.  
CARTERA DE VALORES AL 23 ABRIL, 2026

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
<b>DIRECTO</b>						
<b>BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F</b>						
LF	BONDES F	270923	mxAAA	5,627,011	563,321,860.60	6.37
LF	BONDES F	270909	mxAAA	4,401,300	439,507,330.48	4.97
LF	BONDES F	280210	mxAAA	2,000,000	200,006,482.00	2.26
OTROS TIPO DE VALOR LF - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F				2,000,000	200,529,323.00	2.27
<b>BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES</b>						
S	UDIBONO	261203	mxAAA	206,238	183,038,743.17	2.07
<b>CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS</b>						
94	BLADEX	23	mxAAA	2,352,651	235,565,239.45	2.66
OTROS TIPO DE VALOR 94 - CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS				4,300,000	430,382,386.43	4.87
<b>CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO</b>						
OTROS TIPO DE VALOR 93 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO				2,233,098	218,685,712.26	2.47
<b>CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS</b>						
91	SAKLY	25	AAA(mex)	2,500,000	250,940,042.50	2.84
91	AC	22-2	mxAAA	2,278,000	228,215,067.55	2.58
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS				13,023,781	1,259,165,969.10	14.24
<b>CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL</b>						
95	FNCOT	23S	AAA.mx	2,300,000	230,381,202.00	2.61
OTROS TIPO DE VALOR 95 - CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO				2,962,717	299,695,045.64	3.39
<b>TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES</b>						
JI	CABEI	1-24S	mxAAA	1,820,400	183,045,408.74	2.07
OTROS TIPO DE VALOR JI - TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES				2,645,000	265,684,778.47	3.00
<b>TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC</b>						
D8	GSG1126	FLOAT	BBB+	109	273,669,856.91	3.10
D8	BOA0527	FLOAT	A-	2,500	250,125,729.60	2.83
<b>TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO</b>					<b>5,711,960,177.90</b>	<b>64.60</b>
<b>REPORTO</b>						
IQ	BPAG91	290913	mxAAA	14,266,978	1,429,184,168.17	16.16
2U	CBIC002	300117	mxAAA	484,959	500,083,720.58	5.66
LF	BONDES F	300725	mxAAA	4,021,540	400,074,950.64	4.52
LF	BONDES F	270930	mxAAA	2,047,779	204,728,925.81	2.32
<b>TOTAL REPORTO</b>					<b>2,534,071,765.20</b>	<b>28.66</b>
<b>OTROS VALORES</b>				30,917,238	596,396,997.52	6.74
<b>TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES</b>					<b>8,842,428,940.62</b>	<b>100.00</b>

CATEGORÍA  
IDCP

CALIFICACIÓN  
AAAf/S1(mex)

VaR Promedio  
0.003%

Límite de VaR  
0.197%

Para llevar a cabo la estimación del Valor en Riesgo (VaR) de mercado para las Fondos de Inversión administrados por Operadora GBM, se acordó con la empresa Valor de Mercado (Valmer) que sea ella quien lo realice, siguiendo los criterios metodológicos aprobados por la Unidad de Administración Integral de riesgos de la Operadora.

El método utilizado para la estimación del VaR es el conocido como simulación histórica, con los parámetros que se presentan a continuación:

- Un periodo de muestra de un año
- El nivel de confianza para el VaR fijado al 95%
- El horizonte temporal para el que se estime la posible minusvalía será de 1 día