

**GBMF2 GBM FO
CARTE**

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

DIRECTO

BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F

LF	BONDESF	270923
LF	BONDESF	270909
LF	BONDESF	280210

OTROS TIPO DE VALOR LF - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDI

BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES

S	UDIBONO	261203
---	---------	--------

CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS

94	BLADEX	23
----	--------	----

OTROS TIPO DE VALOR 94 - CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS

CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO

OTROS TIPO DE VALOR 93 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO

CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS

91	SAKLY	25
91	AC	22-2

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

TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO

REPORTO

IS	BPA182	280412
IQ	BPAG91	300516
LF	BONDESF	300124

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.
 CARTERA DE VALORES AL 30 ABRIL, 2026

Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable
mxAAA	5,627,011	564,400,175.97
mxAAA	4,401,300	440,347,146.94
mxAAA	2,000,000	200,418,464.00
ES F	2,000,000	199,829,125.00
mxAAA	206,238	183,541,525.42
mxAAA	2,352,651	236,033,595.80
	4,300,000	431,230,031.09
	2,383,559	233,678,181.78
AAA(mex)	2,500,000	250,205,637.50
mxAAA	2,278,000	228,671,426.12
	13,023,781	1,237,219,659.18
FONDO FEDERAL		
AAA.mx	2,300,000	230,837,133.30
INSTITUCIONES DEL GOBIERNO F	2,962,717	299,684,917.47
mxAAA	1,820,400	182,384,071.98
LATERALES	2,645,000	266,069,922.34
BBB+	109	274,219,789.64
A-	2,500	250,644,303.80
		5,709,415,107.33
mxAAA	10,197,984	1,021,217,543.00
mxAAA	8,595,314	865,830,011.13
mxAAA	4,021,224	400,304,414.85
		2,287,351,968.98

31,501,972

677,091,077.73

8,673,858,154.04

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

nivel de confianza para el VaR fijado al 95%

al para el que se estime la posible minusvalía será de 1 día

Participación Porcentual

6.51

5.08

2.31

2.30

2.12

2.72

4.97

2.69

2.88

2.64

14.26

2.66

3.46

2.10

3.07

3.16

2.89

65.82

11.77

9.98

4.62

26.37

7.81

100.00

que sea ella quien lo realice,