

GBMfondos

GBMF2 GBM FONDO DE CORTO PLAZO, S.A. DE C.V., F.I.I.D.
CARTERA DE VALORES AL 04 JUNIO, 2026

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDES F	270923	mxAAA	5,627,011	561,920,521.03	6.41
LF	BONDES F	270909	mxAAA	4,401,300	440,709,536.78	5.03
LF	BONDES F	280210	mxAAA	2,000,000	199,559,272.00	2.28
OTROS TIPO DE VALOR LF - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F				2,000,000	199,994,775.00	2.28
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES						
S	UDIBONO	261203	mxAAA	206,238	181,709,816.23	2.07
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS						
94	BLADEX	23	mxAAA	2,352,651	236,146,113.69	2.69
OTROS TIPO DE VALOR 94 - CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS				5,300,000	531,806,324.15	6.07
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO						
OTROS TIPO DE VALOR 93 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO				2,724,970	266,891,349.91	3.05
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
91	SAKLY	25	AAA(mex)	2,500,000	250,396,242.50	2.86
91	AC	22-2	mxAAA	2,278,000	228,832,943.15	2.61
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS				9,803,781	977,044,142.11	11.15
CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL						
95	FNCOT	23S	AAA.mx	2,300,000	230,961,066.50	2.64
OTROS TIPO DE VALOR 95 - CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO				2,962,717	297,388,562.39	3.39
TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES						
JI	CABEI	1-24S	mxAAA	1,820,400	182,527,051.66	2.08
OTROS TIPO DE VALOR JI - TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES				2,645,000	265,159,340.81	3.03
TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC						
D8	GSG1126	FLOAT	BBB+	109	274,243,898.00	3.13
D8	BOA0527	FLOAT	A-	2,500	251,165,451.80	2.87
OTROS TIPO DE VALOR D8 - TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC				95	239,752,267.27	2.74
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					5,816,208,674.98	66.37
REPORTO						
IS	BPA182	301010	mxAAA	10,453,874	1,049,211,930.14	11.97
2U	CBIC004	310116	mxAAA	530,783	525,747,142.84	6.00
2U	CBIC002	300117	mxAAA	458,239	474,410,873.56	5.41
LF	BONDES F	310320	mxAAA	4,024,608	400,070,730.28	4.57
TOTAL REPORTO					2,449,440,676.82	27.95
OTROS VALORES				32,360,313	497,485,345.45	5.68
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					8,763,134,697.25	100.00

CATEGORÍA
IDCP

CALIFICACIÓN
AAA/S1(mex)

VaR Promedio
0.002%

Limite 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