

gbmfondos

GBMF2 GBM FONDO DE CORTO PLAZO, S.A. DE C.V., F.I.I.D.
CARTERA DE VALORES AL 13 AGOSTO, 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	563,646,359.07	6.69
LF	BONDES F	270909	mxAAA	4,401,300	439,793,010.06	5.22
LF	BONDES F	280224	mxAAA	3,000,000	299,492,622.00	3.56
LF	BONDES F	280210	mxAAA	2,000,000	200,178,592.00	2.38
OTROS TIPO DE VALOR LF - BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F				2,000,000	200,611,811.00	2.38
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES						
S	UDIBONO	261203	mxAAA	206,238	183,120,197.69	2.18
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS						
OTROS TIPO DE VALOR 94 - CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS				4,526,994	453,252,312.14	5.38
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO						
OTROS TIPO DE VALOR 93 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO				2,577,759	253,829,492.12	3.01
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL						
OTROS TIPO DE VALOR 92 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO GUBERNAMENTAL				1,990,043	195,252,830.99	2.32
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
91	SAKLY	25	AAA(mex)	2,500,000	251,092,470.00	2.98
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS				9,397,306	936,886,650.47	11.13
CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL						
95	PEMEX	14-2	mxAAA	2,540,000	258,779,479.90	3.07
OTROS TIPO DE VALOR 95 - CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO				2,452,717	246,136,217.61	2.92
TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES						
JI	CABEI	1-24S	mxAAA	1,820,400	182,984,778.50	2.17
JI	CABEI	1-23S	mxAAA	1,700,000	170,712,658.70	2.03
TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC						
D8	GSG1126	FLOAT	BBB+	109	273,070,245.04	3.24
D8	BOA0527	FLOAT	A-	2,500	250,480,878.07	2.98
OTROS TIPO DE VALOR D8 - TITULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC				95	239,503,077.55	2.84
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					5,598,823,682.91	66.50
REPORTO						
2U	CBIC002	300117	mxAAA	995,181	1,000,162,140.35	11.88
LF	BONDES F	340323	mxAAA	9,086,259	900,161,655.43	10.69
IQ	BPAG91	280907	mxAAA	3,008,960	303,421,257.04	3.60
TOTAL REPORTO					2,203,745,052.82	26.18
OTROS VALORES				33,581,123	616,647,016.67	7.32
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					8,419,215,752.40	100.00

CATEGORÍA
IDCP

CALIFICACIÓN
AAAF/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