GBMfondos

GBMF2 GBM FONDO DE CORTO PLAZO, S.A. DE C.V., F.I.I.D.
CARTERA DE VALORES AL 30 SEPTIEMBRE, 2026

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDESF	270923	mxAAA	5,627,011	563,037,645.90	6.23
LF	BONDESF	270909	mxAAA	4,401,300	441,521,330.15	4.88
LF	BONDESF	280224	mxAAA	3,000,000	300,686,490.00	3.33
LF	BONDESF	280210	mxAAA	2,000,000	199,973,976.00	2.21
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS						
OTROS TIPO DE VALOR 94 - CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS				5,268,554	528,360,396.47	5.84
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO						
OTROS TIPO DE VALOR 93 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE CORTO PLAZO				2,470,504	244,062,567.51	2.70
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
91	SAKLY	25	AAA(mex)	2,500,000	250,698,220.00	2.77
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS				8,599,172	861,441,138.45	9.53
CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL						
95	PEMEX	14-2	mxAAA	2,540,000	261,374,867.14	2.89
CERTIFICADOS DE DEPÓSITO						
F	CITIMX	26008	mxA-1+	2,000,000	200,882,188.00	2.22
TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES						
JI	CABEI	1-24S	mxAAA	1,882,900	189,049,100.55	2.09
OTROS TIPO DE VALOR JI - TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES				2,645,000	265,464,057.67	2.94
TITULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC						
D8	GSG1126	FLOAT	BBB+	109	273,927,044.24	3.03
D8	BOA0527	FLOAT	A-	2,500	250,102,198.03	2.77
OTROS TIPO DE VALOR D8 - TITULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC				95	239,029,476.58	2.64
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					**5,069,610,696.69**	**56.06**
REPORTO						
LG	BONDESG	290726	mxAAA	10,090,327	1,005,923,048.06	11.12
LF	BONDESF	320415	mxAAA	9,073,758	900,164,952.08	9.95
2U	CBIC004	310116	mxAAA	489,706	470,740,361.53	5.21
2U	CBIC002	300117	mxAAA	328,617	329,390,620.56	3.64
IS	BPA182	320324	mxAAA	1,915,600	196,960,791.08	2.18
TOTAL REPORTO					**2,903,179,773.31**	**32.11**
OTROS VALORES				41,829,036	**1,069,866,599.23**	**11.83**
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					**9,042,657,069.23**	**100.00**

CATEGORÍA
IDCP

CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
AAAf.mxMRA1.mx	0.002%	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

Lic. Julio Andres Maza Casas