

GBMfondos

GBMMOD GBM FONDO DE INVERSION MODELO, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 30 MAYO, 2025

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS						
1	CYDSASA	A	BAJA	1,714,666	31,618,441.04	15.47
1	KUO	B	BAJA	767,000	30,595,630.00	14.97
1	FEMSA	UBD	ALTA	57,695	11,905,363.25	5.82
1	GMEXICO	B	ALTA	111,000	11,803,740.00	5.77
1	ASUR	B	ALTA	15,561	9,685,944.45	4.74
1	WALMEX	*	ALTA	147,865	9,419,000.50	4.61
1	CULTIBA	B	MINIMA	793,065	8,723,715.00	4.27
1	VOLAR	A	ALTA	842,555	7,852,612.60	3.84
1	GFNORTE	O	ALTA	43,000	7,372,780.00	3.61
1	VESTA	*	ALTA	118,000	6,598,560.00	3.23
1	GISSA	A	MEDIA	361,987	6,113,960.43	2.99
1	CTALPEK	A	MEDIA	1,755,254	5,529,050.10	2.70
1	FRAGUA	B	MEDIA	9,000	5,102,820.00	2.50
1	BIMBO	A	ALTA	82,515	4,473,138.15	2.19
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS				318,497	12,494,526.02	6.11
FIDEICOMISOS DE INFRAESTRUCTURA Y BIENES RAICES DE INVERSIÓN INMOBILIARIA						
CF	FMTY	14	ALTA	905,932	12,592,454.80	6.16
CF	FUNO	11	ALTA	211,192	5,763,429.68	2.82
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					187,645,166.02	91.79
OTROS VALORES				306,094	16,787,897.79	8.21
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					204,433,063.81	100.00

CATEGORÍA
RVESACC

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
0.964%

Límite de VaR
3.490%

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