

gbmfondos

GBMMOD GBM FONDO DE INVERSION MODELO, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 30 OCTUBRE, 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	29,320,788.60	14.42
1	KUO	B	MEDIA	322,780	16,461,780.00	8.10
1	GMEXICO	B	ALTA	87,500	14,450,625.00	7.11
1	FEMSA	UBD	ALTA	70,195	12,433,640.35	6.11
1	KOF	UBL	ALTA	75,000	12,106,500.00	5.95
1	ASUR	B	ALTA	19,124	10,855,356.12	5.34
1	BOLSA	A	ALTA	272,361	9,516,293.34	4.68
1	GCC	*	ALTA	49,500	8,761,500.00	4.31
1	CULTIBA	B	BAJA	793,065	8,160,638.85	4.01
1	PINFRA	*	ALTA	30,878	7,593,208.98	3.73
1	WALMEX	*	ALTA	118,465	7,196,748.75	3.54
1	VESTA	*	ALTA	126,000	7,081,200.00	3.48
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	78,285	7,003,376.10	3.44
1	TRAXION	A	ALTA	429,045	6,010,920.45	2.96
1	GISSA	A	BAJA	361,987	5,020,759.69	2.47
1	FRAGUA	B	MEDIA	9,000	4,815,000.00	2.37
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS				265,295	4,557,502.60	2.24
FIDEICOMISOS DE INFRAESTRUCTURA Y BIENES RAICES DE INVERSIÓN INMOBILIARIA						
CF	FUNO	11	ALTA	275,850	7,458,984.00	3.67
CF	FMTY	14	ALTA	509,216	6,915,153.28	3.40
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					185,719,976.11	91.33
PRESTAMO DE VALORES						
1	LAB	B	ALTA	400,000	7,300,000.00	3.59
1	PINFRA	*	ALTA	19,110	4,699,340.10	2.31
OTROS VALORES				173,047	5,632,202.52	2.77
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					203,351,518.73	100.00
TOTAL PRESTAMO DE VALORES					11,999,340.10	5.90

CATEGORÍA
RVESACC

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
0.982%

Limite 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