

GBMfondos

GBMMOD GBM FONDO DE INVERSIÓN MODELO, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 04 DICIEMBRE, 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	29,749,455.10	14.34
1	KUO	B	BAJA	322,780	17,688,344.00	8.53
1	GMEXICO	B	ALTA	98,500	16,450,485.00	7.93
1	KOF	UBL	ALTA	78,241	12,992,700.46	6.26
1	FEMSA	UBD	ALTA	62,800	11,616,116.00	5.60
1	GCC	*	ALTA	49,500	9,537,660.00	4.60
1	ASUR	B	ALTA	16,124	8,909,981.16	4.30
1	BOLSA	A	ALTA	241,361	8,679,341.56	4.18
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	78,285	7,907,567.85	3.81
1	LAB	B	ALTA	417,825	7,809,149.25	3.77
1	WALMEX	*	ALTA	132,465	7,798,214.55	3.76
1	CULTIBA	B	BAJA	702,065	7,722,715.00	3.72
1	VESTA	*	ALTA	121,000	6,890,950.00	3.32
1	PINFRA	*	ALTA	25,378	6,584,829.66	3.17
1	FRAGUA	B	MEDIA	9,000	4,904,910.00	2.36
1	ESENTIA	II	MEDIA	102,000	4,786,860.00	2.31
1	ORBIA	*	ALTA	269,395	4,655,145.60	2.24
1	GISSA	A	BAJA	361,987	4,651,532.95	2.24
FIDEICOMISOS DE INFRAESTRUCTURA Y BIENES RAICES DE INVERSIÓN INMOBILIARIA						
CF	FUNO	11	ALTA	288,850	7,720,960.50	3.72
CF	FMTY	14	ALTA	494,216	7,052,462.32	3.40
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO						
PRESTAMO DE VALORES						
1	PINFRA	*	ALTA	19,110	4,958,471.70	2.39
OTROS VALORES						
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES						
TOTAL PRESTAMO DE VALORES						
CATEGORÍA <small>RVESACC</small>						
CALIFICACIÓN			VaR Promedio 0.966%		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