

gbmfondos

GBMMOD GBM FONDO DE INVERSION MODELO, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 12 FEBRERO, 2026

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	30,006,655.00	12.73
1	KUO	B	BAJA	322,780	19,366,800.00	8.22
1	GMEXICO	B	ALTA	90,500	18,373,310.00	7.80
1	FEMSA	UBD	ALTA	61,150	11,888,171.50	5.05
1	GCC	*	ALTA	60,559	11,744,812.46	4.98
1	ASUR	B	ALTA	15,800	10,106,628.00	4.29
1	ALSEA	*	ALTA	171,429	9,471,452.25	4.02
1	VESTA	*	ALTA	158,000	9,037,600.00	3.84
1	GRUMA	B	ALTA	25,600	8,764,928.00	3.72
1	LAB	B	ALTA	485,900	8,527,545.00	3.62
1	CULTIBA	B	BAJA	702,065	8,459,883.25	3.59
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	78,285	8,031,258.15	3.41
1	ORBIA	*	ALTA	372,381	7,860,962.91	3.34
1	WALMEX	*	ALTA	131,965	7,656,609.30	3.25
1	ESENTIA	II	MEDIA	119,898	6,017,680.62	2.55
1	KOF	UBL	ALTA	28,741	5,679,221.60	2.41
1	FRAGUA	B	MEDIA	10,000	5,289,800.00	2.24
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS				1,696,290	17,195,061.18	7.30
FIDEICOMISOS DE INFRAESTRUCTURA Y BIENES RAICES DE INVERSIÓN EN INFRAESTRUCTURA						
FF	FMX	23	MEDIA	181,818	5,609,085.30	2.38
FIDEICOMISOS DE INFRAESTRUCTURA Y BIENES RAICES DE INVERSIÓN INMOBILIARIA						
CF	FUNO	11	ALTA	369,850	10,855,097.50	4.61
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					219,942,562.02	93.34
REPORTO						
BI	CETES	270513	mxAAA	623,400	5,707,577.85	2.42
TOTAL REPORTO					5,707,577.85	2.42
PRESTAMO DE VALORES						
1	PINFRA	*	ALTA	19,110	5,620,251.00	2.39
OTROS VALORES				15,612	4,361,349.88	1.85
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					235,631,740.75	100.00
TOTAL PRESTAMO DE VALORES					5,620,251.00	2.39

CATEGORÍA
RVESACC

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
0.948%

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