

gbmfondos

GBMMOD GBM FONDO DE INVERSION MODELO, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 27 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	33,264,520.40	14.09
1	KUO	B	BAJA	322,780	19,366,800.00	8.20
1	GMEXICO	B	ALTA	75,500	16,536,765.00	7.00
1	FEMSA	UBD	ALTA	70,150	13,555,786.00	5.74
1	GCC	*	ALTA	64,559	12,932,458.88	5.48
1	ASUR	B	ALTA	16,800	10,400,376.00	4.41
1	VESTA	*	ALTA	158,000	10,021,940.00	4.24
1	ALSEA	*	ALTA	160,334	9,740,290.50	4.13
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	89,285	9,586,530.45	4.06
1	ORBIA	*	ALTA	456,881	9,324,941.21	3.95
1	LAB	B	ALTA	485,900	8,857,957.00	3.75
1	CULTIBA	B	BAJA	702,065	8,494,986.50	3.60
1	WALMEX	*	ALTA	147,965	8,247,569.10	3.49
1	GRUMA	B	ALTA	25,600	7,903,744.00	3.35
1	PINFRA	*	ALTA	24,878	7,059,132.50	2.99
1	ESENTIA	II	MEDIA	125,898	6,518,998.44	2.76
1	FRAGUA	B	MEDIA	10,000	5,374,000.00	2.28
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS				1,719,471	11,374,237.21	4.82
FIDEICOMISOS DE INFRAESTRUCTURA Y BIENES RAICES DE INVERSIÓN EN INFRAESTRUCTURA						
FF	FMX	23	MEDIA	181,818	5,319,994.68	2.25
FIDEICOMISOS DE INFRAESTRUCTURA Y BIENES RAICES DE INVERSIÓN INMOBILIARIA						
CF	FUNO	11	ALTA	369,850	11,065,912.00	4.69
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					224,946,939.87	95.28
PRESTAMO DE VALORES						
1	PINFRA	*	ALTA	19,110	5,422,462.50	2.30
OTROS VALORES				158,454	5,729,728.27	2.43
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					236,099,130.64	100.00
TOTAL PRESTAMO DE VALORES					5,422,462.50	2.30

CATEGORÍA
RVESACC

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
0.947%

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