

GBMfondos

GBMMOD GBM FONDO DE INVERSION MODELO, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 31 MARZO, 2026

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Titulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS						
1	CYDSASA	A	BAJA	1,714,666	34,721,986.50	14.96
1	KUO	B	BAJA	322,780	18,721,240.00	8.07
1	FEMSA	UBD	ALTA	76,150	15,069,323.50	6.49
1	GMEXICO	B	ALTA	69,500	13,338,440.00	5.75
1	GCC	*	ALTA	66,559	12,688,142.17	5.47
1	VESTA	*	ALTA	177,838	10,672,058.38	4.60
1	ASUR	B	ALTA	16,800	10,147,368.00	4.37
1	LIVEPOL	C-1	MEDIA	89,285	9,615,101.65	4.14
1	ALSEA	*	ALTA	164,084	9,492,259.40	4.09
1	ORBIA	*	ALTA	422,881	9,130,000.79	3.93
1	CULTIBA	B	BAJA	702,065	8,775,812.50	3.78
1	ESENTIA	II	MEDIA	160,444	8,745,802.44	3.77
1	PINFRA	*	ALTA	29,878	8,658,943.18	3.73
1	PE&OLES	*	ALTA	10,265	8,177,201.65	3.52
1	GRUMA	B	ALTA	24,300	7,986,195.00	3.44
1	WALMEX	*	ALTA	117,965	6,865,563.00	2.96
1	GAP	B	ALTA	13,500	5,969,025.00	2.57
FIDEICOMISOS DE INFRAESTRUCTURA Y BIENES RAICES DE INVERSIÓN EN INFRAESTRUCTURA						
FF	FMX	23	MEDIA	191,818	5,581,903.80	2.40
FIDEICOMISOS DE INFRAESTRUCTURA Y BIENES RAICES DE INVERSIÓN INMOBILIARIA						
CF	FUNO	11	ALTA	369,850	10,788,524.50	4.65
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					215,144,891.46	92.69
PRESTAMO DE VALORES						
1	PINFRA	*	ALTA	19,110	5,538,269.10	2.39
OTROS VALORES					613,823	4.93
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					232,114,970.04	100.00
TOTAL PRESTAMO DE VALORES					5,538,269.10	2.39

CATEGORÍA
RVESACC

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.106%

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