

GBMfondos

GBMMOD GBM FONDO DE INVERSION MODELO, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 14 MAYO, 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	55,555,178.40	22.31
1	KUO	B	BAJA	322,780	18,721,240.00	7.52
1	FEMSA	UBD	ALTA	64,550	13,581,965.50	5.46
1	VESTA	*	ALTA	189,838	11,285,869.10	4.53
1	ESENTIA	II	MEDIA	194,318	11,103,330.52	4.46
1	ALSEA	*	ALTA	191,531	10,015,155.99	4.02
1	GCC	*	ALTA	46,352	9,982,366.72	4.01
1	GMEXICO	B	ALTA	46,500	9,835,680.00	3.95
1	CULTIBA	B	BAJA	702,065	9,548,084.00	3.84
1	ASUR	B	ALTA	18,300	9,476,106.00	3.81
1	LIVEPOL	C-1	MEDIA	89,285	9,376,710.70	3.77
1	GRUMA	B	ALTA	29,300	8,727,298.00	3.51
1	GAP	B	ALTA	19,000	7,965,370.00	3.20
1	PINFRA	*	ALTA	25,378	7,176,898.40	2.88
1	ORBIA	*	ALTA	295,358	6,905,470.04	2.77
1	OMA	B	ALTA	27,000	6,062,310.00	2.44
1	ENTERA	*	ALTA	115,027	5,157,810.68	2.07
FIDEICOMISOS DE INFRAESTRUCTURA Y BIENES RAICES DE INVERSIÓN EN INFRAESTRUCTURA						
FF	FMX	23	MEDIA	216,818	6,153,294.84	2.47
FIDEICOMISOS DE INFRAESTRUCTURA Y BIENES RAICES DE INVERSIÓN INMOBILIARIA						
CF	FUNO	11	ALTA	351,000	10,442,250.00	4.19
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					227,072,388.89	91.21
PRESTAMO DE VALORES						
1	PINFRA	*	ALTA	19,110	5,404,308.00	2.17
OTROS VALORES					739,625	6.62
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					248,964,878.15	100.00
TOTAL PRESTAMO DE VALORES					5,404,308.00	2.17

CATEGORÍA	RVESACC
CALIFICACIÓN	VaR Promedio
	0.937%
	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