

GBMfondos

GBMMOD GBM FONDO DE INVERSION MODELO, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 29 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	45,095,715.80	18.77
1	KUO	B	BAJA	278,280	16,140,240.00	6.72
1	FEMSA	UBD	ALTA	64,550	13,337,966.50	5.55
1	GCC	*	ALTA	60,053	12,661,574.52	5.27
1	ASUR	B	ALTA	24,300	12,489,714.00	5.20
1	VESTA	*	ALTA	189,838	11,561,134.20	4.81
1	ESENTIA	II	MEDIA	198,318	10,913,439.54	4.54
1	ALSEA	*	ALTA	197,531	10,482,970.17	4.36
1	GMEXICO	B	ALTA	46,500	10,008,660.00	4.16
1	CULTIBA	B	BAJA	702,065	9,548,084.00	3.97
1	LIVEPOL	C-1	MEDIA	89,285	9,127,605.55	3.80
1	GRUMA	B	ALTA	29,300	8,519,268.00	3.55
1	GAP	B	ALTA	20,000	8,166,400.00	3.40
1	PINFRA	*	ALTA	25,878	7,224,361.26	3.01
1	OMA	B	ALTA	32,000	6,976,640.00	2.90
1	ORBIA	*	ALTA	229,358	5,385,325.84	2.24
1	GENTERA	*	ALTA	118,027	5,063,358.30	2.11
FIDEICOMISOS DE INFRAESTRUCTURA Y BIENES RAICES DE INVERSIÓN EN INFRAESTRUCTURA						
FF	FMX	23	MEDIA	216,818	6,721,358.00	2.80
FIDEICOMISOS DE INFRAESTRUCTURA Y BIENES RAICES DE INVERSIÓN INMOBILIARIA						
CF	FUNO	11	ALTA	364,000	10,920,000.00	4.54
CF	FMTY	14	ALTA	376,874	5,362,917.02	2.23
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					225,706,732.70	93.92
PRESTAMO DE VALORES						
1	PINFRA	*	ALTA	19,110	5,334,938.70	2.22
OTROS VALORES					454,102	3.86
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					240,307,746.49	100.00
TOTAL PRESTAMO DE VALORES					5,334,938.70	2.22

CATEGORÍA
RVESACC

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
0.889%

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