

GBMfondos

GBMMOD GBM FONDO DE INVERSION MODELO, S.A. DE C.V., F.I.R.V. CARTERA DE VALORES AL 31 OCTUBRE, 2023

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS						
1	CYDSASA	A	BAJA	2,809,666	52,681,237.50	20.57
1	KUO	B	BAJA	850,053	33,993,619.47	13.27
1	FEMSA	UBD	ALTA	141,700	28,915,302.00	11.29
1	GMEXICO	B	ALTA	277,000	20,367,810.00	7.95
1	CULTIBA	B	BAJA	1,644,193	19,072,638.80	7.45
1	CEMEX	CPO	ALTA	1,518,537	16,445,755.71	6.42
1	GISSA	A	MEDIA	544,380	14,562,165.00	5.69
1	ASUR	B	ALTA	26,000	10,102,300.00	3.95
1	FRAGUA	B	MEDIA	16,500	7,975,935.00	3.11
1	VITRO	A	BAJA	332,508	6,932,791.80	2.71
1	AMX	B	ALTA	435,000	6,477,150.00	2.53
1	PINFRA	L	BAJA	51,366	5,290,184.34	2.07
1	AC	*	ALTA	32,000	5,173,440.00	2.02
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS				826,100	19,663,243.00	7.68
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					247,653,572.62	96.71
OTROS VALORES				162,221	8,427,151.51	3.29
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					256,080,724.13	100.00

	CATEGORÍA RVESACC	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio 0.820%	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

Lic. Julio Andres Maza Casas