

GBMfondos

GBMMOD GBM FONDO DE INVERSION MODELO, S.A. DE C.V., F.I.R.V. CARTERA DE VALORES AL 23 NOVIEMBRE, 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	49,450,121.60	19.20
1	KUO	B	BAJA	850,053	33,976,618.41	13.19
1	GMEXICO	B	ALTA	277,000	21,503,510.00	8.35
1	CULTIBA	B	BAJA	1,644,193	17,116,049.13	6.65
1	CEMEX	CPO	ALTA	1,322,637	15,660,022.08	6.08
1	GISSA	A	MEDIA	544,380	14,594,827.80	5.67
1	ASUR	B	ALTA	26,000	10,482,940.00	4.07
1	GAP	B	ALTA	33,000	8,338,110.00	3.24
1	AMX	B	ALTA	520,000	7,930,000.00	3.08
1	FRAGUA	B	MEDIA	16,500	7,738,500.00	3.01
1	VITRO	A	BAJA	332,508	6,650,160.00	2.58
1	AC	*	ALTA	32,000	5,580,160.00	2.17
1	PINFRA	L	BAJA	51,366	5,367,747.00	2.08
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS				1,217,250	20,589,607.50	8.00
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					224,978,373.52	87.37
PRESTAMO DE VALORES						
1	FEMSA	UBD	ALTA	110,000	24,022,900.00	9.33
OTROS VALORES				353,513	8,507,521.50	3.30
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					257,508,795.02	100.00
TOTAL PRESTAMO DE VALORES					24,022,900.00	9.33

	CATEGORÍA RVESACC	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio 0.824%	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