

GBMfondos

GBMMOD GBM FONDO DE INVERSION MODELO, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 27 MARZO, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual	
DIRECTO							
ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS							
1	KUO	B	BAJA	785,793	33,396,202.50	15.10	
1	CYDSASA	A	BAJA	1,714,666	32,140,587.70	14.53	
1	FEMSA	UBD	ALTA	112,000	24,151,680.00	10.92	
1	GMEXICO	B	ALTA	165,000	16,191,450.00	7.32	
1	CEMEX	CPO	ALTA	966,503	14,178,599.01	6.41	
1	ASUR	B	ALTA	25,200	13,213,872.00	5.97	
1	GISSA	A	BAJA	478,902	11,302,087.20	5.11	
1	CULTIBA	B	BAJA	865,235	9,924,245.45	4.49	
1	GAP	B	ALTA	26,385	7,045,058.85	3.19	
1	FRAGUA	B	MEDIA	8,637	5,792,922.27	2.62	
1	PINFRA	L	MEDIA	47,366	5,511,078.29	2.49	
1	AMX	B	ALTA	306,000	4,767,480.00	2.16	
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS				1,734,500	19,251,465.00	8.70	
TITULOS REFERENCIADOS A ACCIONES							
1B	NAFTRAC	ISHRS	ALTA	200,587	11,443,488.35	5.17	
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					208,310,216.62	94.18	
PRESTAMO DE VALORES							
1	CEMEX	CPO	ALTA	436,134	6,398,085.78	2.89	
OTROS VALORES					161,103	6,473,061.61	2.93
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					221,181,364.01	100.00	
TOTAL PRESTAMO DE VALORES					6,398,085.78	2.89	

	CATEGORÍA RVESACC	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio 0.977%	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