

GBMfondos

GBMMOD GBM FONDO DE INVERSION MODELO, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 11 ABRIL, 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	15.19
1	CYDSASA	A	BAJA	1,714,666	32,955,880.52	14.99
1	FEMSA	UBD	ALTA	112,000	23,100,000.00	10.51
1	GMEXICO	B	ALTA	165,000	17,428,950.00	7.93
1	GISSA	A	MEDIA	478,902	11,349,977.40	5.16
1	ASUR	B	ALTA	19,000	10,037,510.00	4.56
1	CULTIBA	B	MEDIA	865,235	10,036,726.00	4.56
1	CEMEX	CPO	ALTA	581,079	8,338,483.65	3.79
1	FRAGUA	B	MEDIA	8,637	6,227,277.00	2.83
1	GAP	B	ALTA	21,000	5,670,630.00	2.58
1	PINFRA	L	MEDIA	47,366	5,541,822.00	2.52
1	AMX	B	ALTA	306,000	4,681,800.00	2.13
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS				1,728,223	18,106,209.85	8.23
TITULOS REFERENCIADOS A ACCIONES						
1B	NAFTRAC	ISHRS	ALTA	238,117	13,475,041.03	6.13
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					200,346,509.95	91.11
PRESTAMO DE VALORES						
1	CEMEX	CPO	ALTA	400,000	5,740,000.00	2.61
1B	NAFTRAC	ISHRS	ALTA	85,470	4,836,747.30	2.20
OTROS VALORES				389,873	8,970,361.07	4.08
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					219,893,618.32	100.00
TOTAL PRESTAMO DE VALORES					10,576,747.30	4.81

	CATEGORÍA RVESACC	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio 1.007%	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