

GBMfondos

GBMMOD GBM FONDO DE INVERSION MODELO, S.A. DE C.V., F.I.R.V. CARTERA DE VALORES AL 18 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	15.40
1	CYDSASA	A	BAJA	1,714,666	32,921,587.20	15.19
1	FEMSA	UBD	ALTA	112,000	22,721,440.00	10.48
1	GMEXICO	B	ALTA	165,000	17,108,850.00	7.89
1	CEMEX	CPO	ALTA	1,212,637	16,673,758.75	7.69
1	GISSA	A	MEDIA	478,902	11,244,618.96	5.19
1	ASUR	B	ALTA	19,000	9,992,100.00	4.61
1	CULTIBA	B	MEDIA	865,235	9,517,585.00	4.39
1	FRAGUA	B	MEDIA	8,637	6,477,750.00	2.99
1	GAP	B	ALTA	21,000	5,592,930.00	2.58
1	PINFRA	L	MEDIA	47,366	5,449,931.96	2.51
1	AMX	B	ALTA	306,000	4,623,660.00	2.13
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS				1,734,500	18,146,055.00	8.37
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					193,866,469.37	89.42
PRESTAMO DE VALORES						
1B	NAFTRAC	ISHRS	ALTA	173,499	9,634,399.47	4.44
1B	NAFTRAC	ISHRS	ALTA	85,470	4,746,149.10	2.19
OTROS VALORES				220,126	8,547,867.54	3.94
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					216,794,885.48	100.00
TOTAL PRESTAMO DE VALORES					14,380,548.57	6.63

CALIFICACIÓN

CATEGORÍA
RVESACC

VaR Promedio
1.008%

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

Lic. Julio Andres Maza Casas