

GBMfondos

GBMMXOP GBM MEXBOL OPTIMIZADO, S. A. de C. V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 30 ABRIL, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
ACCIONES DE BANCOS						
41	BBAJIO	O	ALTA	219,376	13,855,788.16	6.84
ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS						
1	GFNORTE	O	ALTA	79,714	13,515,508.70	6.67
1	KOF	UBL	ALTA	79,331	13,482,303.45	6.65
1	KIMBER	A	ALTA	361,370	12,886,454.20	6.36
1	ALSEA	*	ALTA	172,266	12,361,808.16	6.10
1	LIVPOL	C-1	ALTA	89,970	12,297,099.60	6.07
1	CHDRAUI	B	ALTA	93,308	11,809,993.56	5.83
1	FEMSA	UBD	ALTA	57,017	11,426,776.97	5.64
1	GRUMA	B	ALTA	28,804	9,691,393.84	4.78
1	WALMEX	*	ALTA	124,518	7,959,190.56	3.93
1	AC	*	ALTA	47,477	7,934,356.24	3.92
1	GMEXICO	B	ALTA	73,015	7,728,637.75	3.81
1	CEMEX	CPO	ALTA	302,775	4,108,656.75	2.03
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS				603,059	22,870,662.36	11.29
TITULOS REFERENCIADOS A ACCIONES						
1B	NAFTRAC	ISHRS	ALTA	122,460	6,903,070.20	3.41
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					168,831,700.50	83.32
PRESTAMO DE VALORES						
1	AC	*	ALTA	38,000	6,350,560.00	3.13
1	AMX	B	ALTA	283,823	4,629,153.13	2.28
1B	NAFTRAC	ISHRS	ALTA	75,499	4,255,878.63	2.10
OTROS VALORES					186,794	9.16
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					202,637,849.88	100.00
TOTAL PRESTAMO DE VALORES					15,235,591.76	7.52

	CATEGORÍA RVESINDIPC	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
	1.099%	1.750%

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