

GBMfondos

GBMMOD GBM FONDO DE INVERSION MODELO, S.A. DE C.V., F.I.R.V. CARTERA DE VALORES AL 25 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	35,046,367.80	15.81
1	CYDSASA	A	BAJA	1,714,666	32,921,587.20	14.85
1	FEMSA	UBD	ALTA	112,000	22,199,520.00	10.02
1	CEMEX	CPO	ALTA	1,212,637	17,098,181.70	7.71
1	GMEXICO	B	ALTA	165,000	16,991,700.00	7.67
1	ASUR	B	ALTA	19,000	11,337,300.00	5.12
1	GISSA	A	MEDIA	478,902	10,866,286.38	4.90
1	CULTIBA	B	MEDIA	865,235	9,059,010.45	4.09
1	FRAGUA	B	MEDIA	8,637	6,546,155.04	2.95
1	PINFRA	L	MEDIA	47,366	5,580,879.48	2.52
1	AMX	B	ALTA	306,000	4,816,440.00	2.17
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS				1,737,687	20,277,041.87	9.15
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					192,740,469.92	86.96
PRESTAMO DE VALORES						
1B	NAFTRAC	ISHRS	ALTA	200,854	11,428,592.60	5.16
1B	NAFTRAC	ISHRS	ALTA	85,470	4,863,243.00	2.19
OTROS VALORES					211,035	5.69
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					221,634,972.27	100.00
TOTAL PRESTAMO DE VALORES					16,291,835.60	7.35

CATEGORÍA RVESACC

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.005%

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