

GBMfondos

GBMMXOP GBM MEXBOL OPTIMIZADO, 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	GFNORTE	O	ALTA	78,714	13,782,034.26	6.74
1	KIMBER	A	ALTA	363,000	13,242,240.00	6.47
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	89,970	12,482,437.80	6.10
1	CHDRAUI	B	ALTA	94,166	12,186,022.06	5.96
1	FEMSA	UBD	ALTA	57,017	11,301,339.57	5.52
1	ALSEA	*	ALTA	114,466	8,501,389.82	4.15
1	WALMEX	*	ALTA	124,518	8,412,436.08	4.11
1	AMX	B	ALTA	530,657	8,352,541.18	4.08
1	AC	*	ALTA	47,477	7,872,161.37	3.85
1	GRUMA	B	ALTA	22,666	7,646,375.10	3.74
1	GMEXICO	B	ALTA	73,015	7,519,084.70	3.67
1	KOF	UBL	ALTA	40,055	6,809,750.55	3.33
1	CEMEX	CPO	ALTA	302,775	4,269,127.50	2.09
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS				343,181	17,439,542.72	8.52
TITULOS REFERENCIADOS A ACCIONES						
1B	NAFTRAC	ISHRS	ALTA	95,460	5,431,674.00	2.65
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					145,248,156.71	70.99
REPORTO						
LD	BONDESD	240822	mxAAA	41,618	4,188,557.83	2.05
TOTAL REPORTO					4,188,557.83	2.05
PRESTAMO DE VALORES						
41	BBAJIO	O	ALTA	139,025	8,630,672.00	4.22
1	KOF	UBL	ALTA	42,830	7,281,528.30	3.56
1	AC	*	ALTA	38,000	6,300,780.00	3.08
1B	NAFTRAC	ISHRS	ALTA	102,499	5,832,193.10	2.85
1	GRUMA	B	ALTA	15,400	5,195,190.00	2.54
OTROS VALORES				287,400	21,940,887.07	10.72
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					204,617,965.01	100.00
TOTAL PRESTAMO DE VALORES					33,240,363.40	16.25

	CATEGORÍA	
	RVESINDIPC	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
	1.098%	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