

GBMfondos

GBMMOD GBM FONDO DE INVERSION MODELO, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 16 MAYO, 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	16.15
1	CYDSASA	A	MEDIA	1,714,666	32,578,654.00	15.01
1	FEMSA	UBD	ALTA	112,000	22,536,640.00	10.38
1	GMEXICO	B	ALTA	163,500	17,303,205.00	7.97
1	CEMEX	CPO	ALTA	1,088,711	14,207,678.55	6.55
1	GISSA	A	MEDIA	478,902	10,464,008.70	4.82
1	WALMEX	*	ALTA	150,000	10,210,500.00	4.70
1	CULTIBA	B	MEDIA	865,235	9,552,194.40	4.40
1	ASUR	B	ALTA	14,000	8,294,160.00	3.82
1	FRAGUA	B	MEDIA	8,637	7,083,117.33	3.26
1	PINFRA	L	MEDIA	47,366	6,302,046.30	2.90
1	AMX	B	ALTA	306,000	5,045,940.00	2.32
	OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS			1,717,500	17,104,115.00	7.88
FIDEICOMISOS DE INFRAESTRUCTURA Y BIENES RAICES DE INVERSIÓN INMOBILIARIA						
	OTROS TIPO DE VALOR CF - FIDEICOMISOS DE INFRAESTRUCTURA Y BIENES RAICES DE INVERSIÓN INMC			361,947	5,736,046.99	2.64
TITULOS REFERENCIADOS A ACCIONES						
1B	NAFTRAC	ISHRS	ALTA	114,017	6,530,893.76	3.01
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					207,995,567.83	95.83
PRESTAMO DE VALORES						
1B	NAFTRAC	ISHRS	ALTA	85,470	4,895,721.60	2.26
OTROS VALORES					187,330	1.91
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					217,039,038.99	100.00
TOTAL PRESTAMO DE VALORES					4,895,721.60	2.26

	CATEGORÍA RVESACC	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio 1.016%	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 período 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