

# GBMfondos

## GBMMOD GBM FONDO DE INVERSIÓN MODELO, S.A. DE C.V., F.I.R.V. CARTERA DE VALORES AL 28 JUNIO, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
<b>DIRECTO</b>						
<b>ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS</b>						
1	KUO	B	BAJA	785,793	33,789,099.00	16.44
1	CYDSASA	A	MEDIA	1,714,666	31,275,507.84	15.22
1	FEMSA	UBD	ALTA	104,000	20,470,320.00	9.96
1	WALMEX	*	ALTA	297,000	18,491,220.00	9.00
1	CEMEX	CPO	ALTA	1,215,100	14,228,821.00	6.92
1	GMEXICO	B	ALTA	141,500	13,925,015.00	6.78
1	GISSA	A	MEDIA	478,902	10,660,358.52	5.19
1	CULTIBA	B	MEDIA	865,235	10,382,820.00	5.05
1	ASUR	B	ALTA	18,000	9,914,400.00	4.82
1	FRAGUA	B	MEDIA	8,637	8,015,481.48	3.90
1	PINFRA	L	MEDIA	63,366	7,477,188.00	3.64
1	KOF	UBL	ALTA	38,000	5,961,060.00	2.90
1	NEMAK	A	MEDIA	1,987,000	5,782,170.00	2.81
1	GCC	*	ALTA	33,000	5,657,190.00	2.75
<b>FIDEICOMISOS DE INFRAESTRUCTURA Y BIENES RAICES DE INVERSIÓN INMOBILIARIA</b>						
OTROS TIPO DE VALOR CF - FIDEICOMISOS DE INFRAESTRUCTURA Y BIENES RAICES DE INVERSIÓN INMC				371,746	5,396,558.72	2.63
<b>TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO</b>					<b>201,427,209.56</b>	<b>98.01</b>
<b>OTROS VALORES</b>				50,047	<b>4,085,008.04</b>	<b>1.99</b>
<b>TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES</b>					<b>205,512,217.60</b>	<b>100.00</b>

	<b>CATEGORÍA</b> RVESACC	
<b>CALIFICACIÓN</b>	<b>VaR Promedio</b> 1.074%	<b>Límite de VaR</b> 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