

GBMfondos

GBMMOD GBM FONDO DE INVERSION MODELO, S.A. DE C.V., F.I.R.V. CARTERA DE VALORES AL 25 JULIO, 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	33,789,099.00	16.85
1	CYDSASA	A	MEDIA	1,714,666	30,006,655.00	14.96
1	WALMEX	*	ALTA	267,000	16,775,610.00	8.36
1	FEMSA	UBD	ALTA	71,000	14,224,140.00	7.09
1	CEMEX	CPO	ALTA	1,175,100	13,748,670.00	6.85
1	GISSA	A	MEDIA	478,902	10,320,338.10	5.15
1	ASUR	B	ALTA	18,000	10,108,800.00	5.04
1	KOF	UBL	ALTA	59,000	9,250,020.00	4.61
1	CULTIBA	B	MEDIA	865,235	8,825,397.00	4.40
1	FRAGUA	B	MEDIA	8,637	8,370,980.40	4.17
1	GMEXICO	B	ALTA	81,000	8,254,710.00	4.12
1	PINFRA	L	MEDIA	63,366	7,540,554.00	3.76
1	GCC	*	ALTA	41,000	6,378,370.00	3.18
1	VESTA	*	ALTA	92,000	5,019,520.00	2.50
1	NEMAK	A	MEDIA	1,987,000	4,967,500.00	2.48
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS				107,000	5,973,110.00	2.98
FIDEICOMISOS DE INFRAESTRUCTURA Y BIENES RAICES DE INVERSIÓN INMOBILIARIA						
OTROS TIPO DE VALOR CF - FIDEICOMISOS DE INFRAESTRUCTURA Y BIENES RAICES DE INVERSIÓN INMC				371,746	5,258,539.42	2.62
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					198,812,012.92	99.12
OTROS VALORES				39,631	1,756,983.60	0.88
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					200,568,996.52	100.00

	CATEGORÍA RVESACC	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio 1.028%	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

Lic. Julio Andres Maza Casas