

GBMfondos

GBMMOD GBM FONDO DE INVERSION MODELO, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 30 AGOSTO, 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	32,924,726.70	16.74
1	CYDSASA	A	MEDIA	1,714,666	29,663,721.80	15.09
1	WALMEX	*	ALTA	190,000	11,926,300.00	6.07
1	FEMSA	UBD	ALTA	56,000	11,281,200.00	5.74
1	FRAGUA	B	MEDIA	10,617	10,390,645.56	5.28
1	ASUR	B	ALTA	19,000	10,031,240.00	5.10
1	GISSA	A	MEDIA	465,000	9,765,000.00	4.97
1	GMEXICO	B	ALTA	92,000	9,271,760.00	4.72
1	GFNORTE	O	ALTA	65,500	8,921,755.00	4.54
1	CULTIBA	B	MEDIA	865,235	8,842,701.70	4.50
1	KOF	UBL	ALTA	50,000	8,272,500.00	4.21
1	CEMEX	CPO	ALTA	675,100	8,080,947.00	4.11
1	PINFRA	L	MEDIA	63,366	7,575,405.30	3.85
1	GCC	*	ALTA	45,000	6,777,900.00	3.45
1	VESTA	*	ALTA	114,000	6,156,000.00	3.13
1	NEMAK	A	MEDIA	1,987,000	4,411,140.00	2.24
1	OMA	B	ALTA	25,000	3,941,750.00	2.00
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					188,234,693.06	95.72
OTROS VALORES				516,263	8,407,210.24	4.28
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					196,641,903.30	100.00

CALIFICACIÓN	CATEGORÍA RVESACC	VaR Promedio	Límite de VaR
		1.066%	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