

GBMfondos

GBMMOD GBM FONDO DE INVERSION MODELO, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 05 DICIEMBRE, 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	32,217,513.00	17.21
1	CYDSASA	A	BAJA	1,714,666	29,595,135.16	15.81
1	WALMEX	*	ALTA	222,000	12,658,440.00	6.76
1	FEMSA	UBD	ALTA	56,000	10,408,720.00	5.56
1	PINFRA	L	MEDIA	60,000	8,850,000.00	4.73
1	ASUR	B	ALTA	16,000	8,601,440.00	4.59
1	CULTIBA	B	BAJA	793,065	8,327,182.50	4.45
1	GMEXICO	B	ALTA	79,000	8,257,870.00	4.41
1	OMA	B	ALTA	39,500	6,999,795.00	3.74
1	GISSA	A	MEDIA	378,387	6,697,449.90	3.58
1	VESTA	*	ALTA	132,000	6,676,560.00	3.57
1	GCC	*	ALTA	35,000	6,653,150.00	3.55
1	FRAGUA	B	MEDIA	9,997	6,333,799.29	3.38
1	CEMEX	CPO	ALTA	502,890	5,929,073.10	3.17
1	KIMBER	A	ALTA	184,000	5,106,000.00	2.73
1	NEMAK	A	MEDIA	2,060,000	4,161,200.00	2.22
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS				137,718	5,026,723.30	2.68
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					172,500,051.25	92.12
PRESTAMO DE VALORES						
1	GFNORTE	O	ALTA	40,982	5,751,823.70	3.07
OTROS VALORES				391,841	8,997,640.86	4.81
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					187,249,515.81	100.00
TOTAL PRESTAMO DE VALORES					5,751,823.70	3.07

	CATEGORÍA RVESACC	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio 0.963%	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