

GBMfondos

GBMMOD GBM FONDO DE INVERSION MODELO, S.A. DE C.V., F.I.R.V. CARTERA DE VALORES AL 14 NOVIEMBRE, 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	36,146,478.00	19.07
1	CYDSASA	A	BAJA	1,714,666	28,806,388.80	15.20
1	WALMEX	*	ALTA	225,000	12,384,000.00	6.54
1	FEMSA	UBD	ALTA	52,000	9,687,600.00	5.11
1	FRAGUA	B	MEDIA	9,997	8,357,492.00	4.41
1	ASUR	B	ALTA	15,000	8,067,450.00	4.26
1	CULTIBA	B	BAJA	793,065	8,009,956.50	4.23
1	GMEXICO	B	ALTA	77,000	7,882,490.00	4.16
1	PINFRA	L	MEDIA	56,717	7,571,719.50	4.00
1	GISSA	A	MEDIA	432,989	7,425,761.35	3.92
1	GFNORTE	O	ALTA	48,000	6,901,440.00	3.64
1	GCC	*	ALTA	37,000	6,634,100.00	3.50
1	CEMEX	CPO	ALTA	566,800	6,212,128.00	3.28
1	VESTA	*	ALTA	113,677	5,856,639.04	3.09
1	OMA	B	ALTA	31,000	5,204,280.00	2.75
1	KIMBER	A	ALTA	156,000	4,392,960.00	2.32
1	AC	*	ALTA	23,808	3,991,887.36	2.11
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS				2,273,000	9,169,630.00	4.84
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					182,702,400.55	96.41
OTROS VALORES				411,719	6,800,597.31	3.59
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					189,502,997.86	100.00

CATEGORÍA RVESACC

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
0.948%

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