

GBMfondos

GBMMOD GBM FONDO DE INVERSION MODELO, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 31 OCTUBRE, 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	32,995,448.07	17.65
1	CYDSASA	A	MEDIA	1,714,666	27,194,602.76	14.55
1	WALMEX	*	ALTA	222,000	12,214,440.00	6.53
1	FEMSA	UBD	ALTA	55,000	10,682,650.00	5.71
1	FRAGUA	B	MEDIA	9,997	8,797,360.00	4.71
1	GCC	*	ALTA	53,000	8,672,920.00	4.64
1	CULTIBA	B	BAJA	793,065	8,144,777.55	4.36
1	PINFRA	L	MEDIA	58,189	7,827,002.39	4.19
1	CEMEX	CPO	ALTA	729,100	7,684,714.00	4.11
1	ASUR	B	ALTA	14,000	7,492,380.00	4.01
1	GISSA	A	MEDIA	432,989	7,421,431.46	3.97
1	GFNORTE	O	ALTA	50,000	6,966,500.00	3.73
1	VESTA	*	ALTA	123,472	6,456,350.88	3.45
1	GMEXICO	B	ALTA	56,000	5,862,640.00	3.14
1	OMA	B	ALTA	31,000	5,195,910.00	2.78
1	NEMAK	A	MEDIA	1,987,000	4,192,570.00	2.24
1	KIMBER	A	ALTA	144,540	4,152,634.20	2.22
1	AC	*	ALTA	22,000	3,768,820.00	2.02
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS				151,000	4,102,600.00	2.19
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					179,825,751.31	96.18
OTROS VALORES				402,418	7,136,382.53	3.82
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					186,962,133.84	100.00

CATEGORÍA RVESACC

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
0.966%

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