

# GBMfondos

GBMMOD GBM FONDO DE INVERSION MODELO, S.A. DE C.V., F.I.R.V.  
CARTERA DE VALORES AL 09 MAYO, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual	
<b>DIRECTO</b>							
<b>ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS</b>							
1	KUO	B	BAJA	785,793	35,046,367.80	16.11	
1	CYDSASA	A	MEDIA	1,714,666	32,955,880.52	15.15	
1	FEMSA	UBD	ALTA	112,000	22,827,840.00	10.50	
1	GMEXICO	B	ALTA	163,500	16,992,555.00	7.81	
1	CEMEX	CPO	ALTA	1,108,837	14,669,913.51	6.75	
1	GISSA	A	MEDIA	478,902	10,392,173.40	4.78	
1	WALMEX	*	ALTA	150,000	10,251,000.00	4.71	
1	CULTIBA	B	MEDIA	865,235	9,258,014.50	4.26	
1	ASUR	B	ALTA	14,000	8,142,960.00	3.74	
1	FRAGUA	B	MEDIA	8,637	6,909,600.00	3.18	
1	PINFRA	L	MEDIA	47,366	6,394,410.00	2.94	
1	AMX	B	ALTA	306,000	5,208,120.00	2.39	
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS				1,717,500	17,068,575.00	7.85	
<b>FIDEICOMISOS DE INFRAESTRUCTURA Y BIENES RAICES DE INVERSIÓN INMOBILIARIA</b>							
OTROS TIPO DE VALOR CF - FIDEICOMISOS DE INFRAESTRUCTURA Y BIENES RAICES DE INVERS				361,800	5,684,817.47	2.61	
<b>TITULOS REFERENCIADOS A ACCIONES</b>							
1B	NAFTRAC	ISHRS	ALTA	141,117	8,133,983.88	3.74	
<b>TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO</b>					<b>209,936,211.08</b>	<b>96.53</b>	
<b>PRESTAMO DE VALORES</b>							
1B	NAFTRAC	ISHRS	ALTA	85,470	4,926,490.80	2.27	
<b>OTROS VALORES</b>					142,903	2,625,133.51	1.21
<b>TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES</b>					<b>217,487,835.39</b>	<b>100.00</b>	
<b>TOTAL PRESTAMO DE VALORES</b>					<b>4,926,490.80</b>	<b>2.27</b>	

	<b>CATEGORÍA</b>	
	RVESACC	
<b>CALIFICACIÓN</b>	<b>VaR Promedio</b>	<b>Límite de VaR</b>
	1.012%	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