

GBMfondos

GBMMOD GBM FONDO DE INVERSION MODELO, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 28 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	33,710,519.70	18.08
1	CYDSASA	A	BAJA	1,714,666	28,806,388.80	15.45
1	WALMEX	*	ALTA	231,000	12,340,020.00	6.62
1	FEMSA	UBD	ALTA	55,000	9,851,600.00	5.28
1	PINFRA	L	MEDIA	60,000	8,520,000.00	4.57
1	ASUR	B	ALTA	15,500	8,248,325.00	4.42
1	GMEXICO	B	ALTA	79,000	7,935,550.00	4.26
1	CULTIBA	B	BAJA	793,065	7,922,719.35	4.25
1	FRAGUA	B	MEDIA	9,997	6,847,945.00	3.67
1	VESTA	*	ALTA	132,000	6,539,280.00	3.51
1	GCC	*	ALTA	37,000	6,517,550.00	3.50
1	GISSA	A	MEDIA	378,387	6,394,740.30	3.43
1	OMA	B	ALTA	36,000	5,995,080.00	3.21
1	CEMEX	CPO	ALTA	491,163	5,515,760.49	2.96
1	KIMBER	A	ALTA	167,898	4,617,195.00	2.48
1	NEMAK	A	MEDIA	2,060,000	3,811,000.00	2.04
				228,518	8,596,728.50	4.61
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS						
FIDEICOMISOS DE INFRAESTRUCTURA Y BIENES RAICES DE INVERSIÓN INMOBILIARIA						
OTROS TIPO DE VALOR CF - FIDEICOMISOS DE INFRAESTRUCTURA Y BIENES RAICES DE INVERSIÓN INMOBILIARIA				298,431	4,028,444.65	2.16
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					176,198,846.79	94.49
PRESTAMO DE VALORES						
1	GFNORTE	O	ALTA	40,982	5,563,306.50	2.98
OTROS VALORES				177,536	4,714,142.75	2.53
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					186,476,296.04	100.00
TOTAL PRESTAMO DE VALORES					5,563,306.50	2.98

CATEGORÍA
RVESACC

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
0.945%

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