

GBMfondos

GBMMXOP GBM MEXBOL OPTIMIZADO, S. A. de C. V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 27 JUNIO, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual	
DIRECTO							
ACCIONES DE BANCOS							
41	BBAJIO	O	ALTA	219,556	11,871,392.92	6.21	
ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS							
1	KOF	UBL	ALTA	88,672	13,831,058.56	7.23	
1	CHDRAUI	B	ALTA	94,335	11,986,205.10	6.27	
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	89,970	11,873,340.90	6.21	
1	KIMBER	A	ALTA	363,000	11,488,950.00	6.01	
1	ALSEA	*	ALTA	178,616	11,363,549.92	5.94	
1	FEMSA	UBD	ALTA	57,017	11,108,622.11	5.81	
1	GFNORTE	O	ALTA	76,864	10,974,641.92	5.74	
1	GRUMA	B	ALTA	32,014	10,685,312.78	5.59	
1	AMX	B	ALTA	530,657	8,209,263.79	4.29	
1	WALMEX	*	ALTA	124,518	7,731,322.62	4.04	
1	OMA	B	ALTA	49,000	7,506,800.00	3.93	
1	CEMEX	CPO	ALTA	603,000	7,073,190.00	3.70	
1	GMEXICO	B	ALTA	73,015	7,013,090.75	3.67	
1	ASUR	B	ALTA	10,400	5,682,976.00	2.97	
1	GENEREA	*	ALTA	244,000	5,673,000.00	2.97	
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS					379,807	15,384,734.80	8.05
TITULOS REFERENCIADOS A ACCIONES							
1B	NAFTRAC	ISHRS	ALTA	92,434	4,837,995.56	2.53	
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					174,295,447.73	91.16	
PRESTAMO DE VALORES							
1B	NAFTRAC	ISHRS	ALTA	99,612	5,213,692.08	2.73	
OTROS VALORES					86,750	11,696,439.06	6.12
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					191,205,578.87	100.00	
TOTAL PRESTAMO DE VALORES					5,213,692.08	2.73	

CALIFICACIÓN	CATEGORÍA	VaR Promedio	Limite de VaR
	RVESINDIPC		
		1.144%	1.750%

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