

# GBMfondos

GBMMXOP GBM MEXBOL OPTIMIZADO, S. A. de C. V., F.I.R.V.  
CARTERA DE VALORES AL 28 JUNIO, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
<b>DIRECTO</b>						
<b>ACCIONES DE BANCOS</b>						
41	BBAJIO	O	ALTA	219,556	12,187,553.56	6.33
<b>ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS</b>						
1	KOF	UBL	ALTA	88,672	13,909,976.64	7.23
1	CHDRAUI	B	ALTA	94,287	11,981,049.09	6.23
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	89,970	11,798,665.80	6.13
1	GFNORTE	O	ALTA	79,714	11,364,027.84	5.91
1	ALSEA	*	ALTA	178,616	11,359,977.60	5.90
1	FEMSA	UBD	ALTA	57,017	11,222,656.11	5.83
1	OMA	B	ALTA	61,000	9,464,760.00	4.92
1	WALMEX	*	ALTA	124,518	7,752,490.68	4.03
1	PINFRA	*	ALTA	44,530	7,537,147.80	3.92
1	GMEXICO	B	ALTA	73,015	7,185,406.15	3.73
1	CEMEX	CPO	ALTA	603,000	7,061,130.00	3.67
1	GRUMA	B	ALTA	20,558	6,862,054.82	3.57
1	AMX	B	ALTA	371,508	5,784,379.56	3.01
1	ASUR	B	ALTA	10,400	5,728,320.00	2.98
1	ORBIA	*	ALTA	170,737	4,358,915.61	2.27
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS				492,618	17,578,057.22	9.14
<b>TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO</b>					<b>163,136,568.48</b>	<b>84.78</b>
<b>PRESTAMO DE VALORES</b>						
1	KIMBER	A	ALTA	320,000	10,128,000.00	5.26
1	GRUMA	B	ALTA	15,565	5,195,441.35	2.70
<b>OTROS VALORES</b>				345,367	<b>13,966,414.41</b>	<b>7.26</b>
<b>TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES</b>					<b>192,426,424.24</b>	<b>100.00</b>
<b>TOTAL PRESTAMO DE VALORES</b>					<b>15,323,441.35</b>	<b>7.96</b>

	<b>CATEGORÍA</b> RVESINDIPC	
<b>CALIFICACIÓN</b>	<b>VaR Promedio</b> 1.151%	<b>Límite de VaR</b> 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