

# GBMfondos

GBMMOD GBM FONDO DE INVERSION MODELO, S.A. DE C.V., F.I.R.V.  
CARTERA DE VALORES AL 29 DICIEMBRE, 2023

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
<b>DIRECTO</b>						
<b>ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS</b>						
1	CYDSASA	A	BAJA	2,659,666	50,533,654.00	18.17
1	KUO	B	BAJA	850,053	37,572,342.60	13.51
1	FEMSA	UBD	ALTA	124,206	27,449,526.00	9.87
1	GMEXICO	B	ALTA	261,000	24,580,980.00	8.84
1	CEMEX	CPO	ALTA	1,520,637	20,102,821.14	7.23
1	CULTIBA	B	BAJA	1,576,193	19,670,888.64	7.07
1	ASUR	B	ALTA	28,700	14,277,102.00	5.13
1	GISSA	A	MEDIA	524,880	13,904,071.20	5.00
1	GAP	B	ALTA	32,100	9,515,403.00	3.42
1	FRAGUA	B	MEDIA	16,500	8,250,000.00	2.97
1	AMX	B	ALTA	520,000	8,184,800.00	2.94
1	AC	*	ALTA	32,000	5,933,120.00	2.13
1	PINFRA	L	BAJA	51,366	5,907,090.00	2.12
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS				1,785,000	23,267,490.00	8.37
<b>TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO</b>					<b>269,149,288.58</b>	<b>96.78</b>
<b>OTROS VALORES</b>				241,418	<b>8,952,760.59</b>	<b>3.22</b>
<b>TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES</b>					<b>278,102,049.17</b>	<b>100.00</b>

**CATEGORÍA**  
RVESACC

**CALIFICACIÓN**

**VaR Promedio**  
0.891%

**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