

GBMfondos

GBMMXOP GBM MEXBOL OPTIMIZADO, 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
DIRECTO						
ACCIONES DE BANCOS						
41	BBAJIO	O	ALTA	227,779	12,937,847.20	6.17
ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS						
1	FEMSA	UBD	ALTA	65,272	14,425,112.00	6.88
1	GFNORTE	O	ALTA	77,693	13,266,856.68	6.32
1	ALSEA	*	ALTA	195,907	12,569,393.12	5.99
1	KOF	UBL	ALTA	77,115	12,413,201.55	5.92
1	LAB	B	ALTA	852,872	12,076,667.52	5.76
1	WALMEX	*	ALTA	145,943	10,445,140.51	4.98
1	BOLSA	A	ALTA	293,751	10,322,410.14	4.92
1	CHDRAUI	B	ALTA	95,517	9,798,133.86	4.67
1	AMX	B	ALTA	617,879	9,725,415.46	4.64
1	AC	*	ALTA	45,530	8,441,717.30	4.02
1	GMEXICO	B	ALTA	72,653	6,842,459.54	3.26
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS				565,929	20,710,418.13	9.87
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					153,974,773.01	73.39
PRESTAMO DE VALORES						
1B	NAFTRAC	ISHRS	ALTA	145,318	8,300,564.16	3.96
1	AC	*	ALTA	38,000	7,045,580.00	3.36
1	KIMBER	A	ALTA	181,732	6,936,710.44	3.31
1B	NAFTRAC	ISHRS	ALTA	85,470	4,882,046.40	2.33
OTROS VALORES					458,894	13.66
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					209,797,137.56	100.00
TOTAL PRESTAMO DE VALORES					27,164,901.00	12.95

CATEGORÍA
RVESINDIPC

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.172%

Límite de VaR
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 período 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