

GBMfondos

GBMMOD GBM FONDO DE INVERSION MODELO, S.A. DE C.V., F.I.R.V. CARTERA DE VALORES AL 22 DICIEMBRE, 2022

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
TÍTULOS PARA NEGOCIAR						
INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO						
EMPRESAS MATERIALES						
1	CEMEX	CPO	ALTA	2,220,000	18,048,600.00	5.63
1	CYDSASA	A	BAJA	3,424,602	51,369,030.00	16.03
1	GMEXICO	B	ALTA	324,000	23,635,800.00	7.38
1	VITRO	A	BAJA	394,290	8,674,380.00	2.71
EMPRESAS INDUSTRIALES						
1	GISSA	A	MEDIA	694,872	22,027,442.40	6.87
1	KUO	B	BAJA	978,001	43,217,864.19	13.49
1	LASITE	B-1	ALTA	240,347	2,331,365.90	0.73
1	ORBIA	*	ALTA	149,000	5,198,610.00	1.62
1	PINFRA	*	ALTA	15,000	2,503,200.00	0.78
1	PINFRA	L	MEDIA	65,366	6,405,868.00	2.00
1	VESTA	*	ALTA	60,000	2,762,400.00	0.86
EMPRESAS DE SERVICIOS Y BIENES DE CONSUMO NO BÁSICO						
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	80,000	8,976,800.00	2.80
1	NEMAK	A	ALTA	712,319	4,216,928.48	1.32
EMPRESAS DE PRODUCTOS DE CONSUMO FRECUENTE						
1	BACHOCO	B	MEDIA	35,000	2,878,050.00	0.90
1	CULTIBA	B	BAJA	2,573,340	30,854,346.60	9.63
1	FEMSA	UBD	ALTA	230,000	35,040,500.00	10.94
1	GRUMA	B	ALTA	17,000	4,371,550.00	1.36
1	KOF	UBL	ALTA	35,000	4,715,550.00	1.47
EMPRESAS DE SALUD						
1	FRAGUA	B	MEDIA	21,750	6,960,000.00	2.17
EMPRESAS DE SERVICIOS DE TELECOMUNICACIONES						
1	AMX	L	ALTA	1,575,000	28,444,500.00	8.88
1	TLEVISA	CPO	ALTA	315,000	5,651,100.00	1.76
TOTAL INVERSIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO NETO					318,283,885.57	99.34
TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR					318,283,885.57	99.34
OPERACIONES DE REPORTE						
REPORTADOR						
LF	BONDESF	240229	mxAAA	21,182	2,123,299.23	0.66
TOTAL OPERACIONES DE REPORTE					2,123,299.23	0.66
TOTAL DE INVERSIÓN EN VALORES					320,407,184.80	100.00

CATEGORÍA ESPECIALIZADA EN ACCIONES

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.092%

Límite de VaR
2.300%

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