

GBMfondos

GBMMOD GBM FONDO DE INVERSION MODELO, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 19 DICIEMBRE, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
ACCIONES DE BANCOS						
41	BBAJIO	O	ALTA	105,000	4,450,950.00	2.43
ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS						
1	KUO	B	BAJA	785,793	34,574,892.00	18.84
1	CYDSASA	A	BAJA	1,714,666	28,720,655.50	15.65
1	GFNORTE	O	ALTA	75,964	10,027,248.00	5.46
1	FEMSA	UBD	ALTA	58,000	9,983,540.00	5.44
1	WALMEX	*	ALTA	155,211	9,006,894.33	4.91
1	PINFRA	L	MEDIA	60,000	8,970,250.32	4.89
1	GMEXICO	B	ALTA	88,548	8,628,117.12	4.70
1	CULTIBA	B	BAJA	793,065	8,168,569.50	4.45
1	ASUR	B	ALTA	14,500	7,751,120.00	4.22
1	OMA	B	ALTA	39,000	7,101,120.00	3.87
1	GISSA	A	MEDIA	378,401	6,432,817.00	3.50
1	GCC	*	ALTA	35,000	6,317,150.00	3.44
1	FRAGUA	B	MEDIA	9,997	5,631,610.01	3.07
1	VESTA	*	ALTA	109,000	5,626,580.00	3.07
1	KIMBER	A	ALTA	184,000	5,142,800.00	2.80
1	NEMAK	A	MEDIA	1,633,000	3,821,220.00	2.08
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS				383,100	4,905,254.00	2.67
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					175,260,787.78	95.49
OTROS VALORES				274,746	8,275,428.07	4.51
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					183,536,215.85	100.00

CATEGORÍA
RVESACC

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
0.998%

Limite 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