

GBMfondos

GBMAGR GBM FONDO DE INVERSION TOTAL, S.A. DE C.V., F.I.R.V. CARTERA DE VALORES AL 14 NOVIEMBRE, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS						
1	KUO	B	BAJA	26,319,135	1,210,680,210.00	13.08
1	LACOMER	UBC	ALTA	31,954,878	1,122,894,412.92	12.13
1	POSADAS	A	MINIMA	32,058,704	833,526,304.00	9.00
1	LAMOSAS	*	MEDIA	6,441,839	766,578,841.00	8.28
1	SORIANA	B	BAJA	24,503,902	710,613,158.00	7.68
1	FRAGUA	B	MEDIA	796,956	666,255,216.00	7.20
1	HERDEZ	*	MEDIA	10,080,240	526,894,144.80	5.69
1	GIGANTE	*	BAJA	18,261,010	511,308,280.00	5.52
1	GBM	O	BAJA	31,954,413	348,303,101.70	3.76
1	SIMEC	B	MEDIA	1,536,519	284,225,284.62	3.07
1	ICH	B	MEDIA	1,504,645	262,786,249.25	2.84
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	1,808,425	191,602,628.75	2.07
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS				49,530,097	919,799,551.15	9.94
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	IB01	N	ALTA	327,988	758,787,146.69	8.20
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					9,114,254,528.88	98.45
OTROS VALORES				43,290,971	143,061,568.85	1.55
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					9,257,316,097.73	100.00

	CATEGORÍA	
	RVESACC	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
	0.568%	3.250%

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