

GBMfondos

GBMCRE GBM FONDO DE CRECIMIENTO, 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	3,255,428	149,749,688.00	25.01
1	FRAGUA	B	MEDIA	118,816	99,330,176.00	16.59
1	CYDSASA	A	BAJA	5,044,691	84,750,808.80	14.15
1	CULTIBA	B	BAJA	7,735,508	78,128,630.80	13.05
1	PASA	B	MINIMA	1,925,591	75,098,049.00	12.54
1	GMD	*	MINIMA	3,588,110	40,186,832.00	6.71
1	GISSA	A	MEDIA	1,466,016	25,142,174.40	4.20
1	WALMEX	*	ALTA	226,000	12,439,040.00	2.08
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS				3,793,341	33,405,492.07	5.58
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					598,230,891.07	99.90
OTROS VALORES				40,115	601,452.30	0.10
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					598,832,343.37	100.00

	CATEGORÍA	
	RVDIS	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
	0.905%	2.740%

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