

gbmfondos

GBMGLB GBM GLOBAL, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 14 NOVIEMBRE, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Valor Razonable	%
DIRECTO					
ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS					
1	LAMOSA	*	MEDIA	244,101,844.00	9.61
1	KUO	B	BAJA	207,950,360.00	8.19
1	GISSA	A	MEDIA	153,148,934.05	6.03
1	AGUILAS	CPO	MEDIA	102,946,619.39	4.05
1	WALMEX	*	ALTA	99,072,000.00	3.90
1	SORIANA	B	BAJA	92,953,149.00	3.66
1	GFNORTE	O	ALTA	90,581,400.00	3.57
1	GMXT	*	MEDIA	86,108,400.00	3.39
1	FEMSA	UBD	ALTA	82,112,842.80	3.23
1	CULTIBA	B	BAJA	82,043,178.70	3.23
1	AGUA	*	MEDIA	73,358,400.00	2.89
1	GCC	*	ALTA	69,568,400.00	2.74
1	CYDSASA	A	BAJA	65,465,383.20	2.58
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	61,847,464.90	2.44
1	OMA	B	ALTA	57,798,397.92	2.28
1				352,180,142.51	13.87
FIDEICOMISOS DE INFRAESTRUCTURA Y BIENES RAICES DE INVERSIÓN INMOBILIARIA					
CF	FNOVA	17	MEDIA	69,329,944.14	2.73
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO				1,990,566,860.61	78.40
PRESTAMO DE VALORES					
1	CEMEX	CPO	ALTA	105,216,000.00	4.14
1	GMEXICO	B	ALTA	92,133,000.00	3.63
1	ASUR	B	ALTA	91,431,100.00	3.60
1	FEMSA	UBD	ALTA	55,890,000.00	2.20
OTROS VALORES				203,674,255.86	8.02
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES				2,538,911,216.47	100.00
TOTAL PRESTAMO DE VALORES				344,670,100.00	13.58

CATEGORÍA	CALIFICACIÓN
RVDIS	
VaR Promedio última semana	Límite de VaR
0.820%	1.840%

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

