

GBMfondos

GBMV1 GBM INVERSIONES BURSATILES, 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	FRAGUA	B	MEDIA	1,023,791	855,889,276.00	33.52
1	BAFAR	B	BAJA	6,270,602	627,060,200.00	24.56
1	GIGANTE	*	BAJA	10,000,000	280,000,000.00	10.96
1	CYDSASA	A	BAJA	10,664,402	179,161,953.60	7.02
1	CULTIBA	B	BAJA	14,040,634	141,810,403.40	5.55
1	GMD	*	MINIMA	12,181,560	136,433,472.00	5.34
1	CIDMEGA	*	MINIMA	3,745,200	127,299,348.00	4.99
1	GISSA	A	MEDIA	3,605,767	61,838,904.05	2.42
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS				44,910,819	131,601,896.16	5.15
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					2,541,095,453.21	99.51
OTROS VALORES				122,815	12,530,834.86	0.49
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					2,553,626,288.07	100.00

	CATEGORÍA	
	RVESACC	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
	1.019%	2.050%

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