

gbmfondos

NUMC FONDO ADMINISTRADO 5, 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	ICH	B	MEDIA	2,611,666,150.10	18.71
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	1,485,656,857.75	10.64
1	LACOMER	UBC	ALTA	1,035,838,717.48	7.42
1	GIGANTE	*	BAJA	1,030,771,616.00	7.38
1	SIMEC	B	MEDIA	883,016,458.44	6.33
1	SORIANA	B	BAJA	802,577,175.00	5.75
1	DINE	B	MINIMA	792,652,140.00	5.68
1	CHDRAUI	B	ALTA	696,384,133.98	4.99
1	POSADAS	A	MINIMA	607,397,024.00	4.35
1	KUO	B	BAJA	586,190,282.00	4.20
1	PASA	B	MINIMA	538,865,028.00	3.86
1	KUO	A	MINIMA	468,025,647.06	3.35
1				931,357,169.64	6.67
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)					
1ISP	IB01	N	ALTA	1,127,242,680.74	8.08
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO				13,597,641,080.19	97.41
OTROS VALORES				361,997,030.49	2.59
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES				13,959,638,110.68	100.00

CATEGORÍA
RVDIS

CALIFICACIÓN

VaR Promedio última semana
0.786%

Límite de VaR
3.240%

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