

# GBMfondos

GBM102 GBM 102, S.A. DE C.V., F.I.R.V.  
CARTERA DE VALORES AL 31 OCTUBRE, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Valor Razonable	%
<b>DIRECTO</b>					
<b>ACCIONES DE FONDOS DE INVERSIÓN DE RENTA VARIABLE</b>					
52	GBMV1	BFF	NA	186,925,155.55	15.28
<b>ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS</b>					
1	FRAGUA	B	MEDIA	211,380,400.00	17.28
1	KUO	B	BAJA	131,524,773.12	10.75
1	BAFAR	B	BAJA	130,979,779.00	10.71
1	GMD	*	MINIMA	82,850,488.00	6.77
1	AGUILAS	CPO	MEDIA	66,193,410.00	5.41
1	CYDSASA	A	MEDIA	62,141,399.06	5.08
1	PINFRA	L	MEDIA	52,385,188.52	4.28
1	GBM	O	BAJA	48,699,530.10	3.98
1	AGUA	*	MEDIA	47,705,761.40	3.90
1	GISSA	A	MEDIA	45,440,231.08	3.72
1	CULTIBA	B	BAJA	43,754,646.91	3.58
1				87,120,933.95	7.12
<b>TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO</b>				1,197,101,696.69	97.88
<b>OTROS VALORES</b>				25,982,446.63	2.12
<b>TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES</b>				1,223,084,143.32	100.00

**CATEGORÍA**  
RVDIS

**CALIFICACIÓN**

**VaR Promedio última semana**  
0.944%

**Límite de VaR**  
2.670%

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

**Composición de las Carteras de los Fondos Origen**

