

GBMfondos

GBM103 GBM 103, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 31 OCTUBRE, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Valor Razonable	%
DIRECTO					
ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS					
1	FRAGUA	B	MEDIA	264,557,920.00	18.84
1	KUO	B	BAJA	190,114,469.87	13.54
1	AGUA	*	MEDIA	175,742,134.92	12.52
1	CULTIBA	B	BAJA	134,927,157.30	9.61
1	BAFAR	B	BAJA	99,609,009.00	7.09
1	GMD	*	MINIMA	85,301,417.60	6.08
1	PINFRA	L	MEDIA	83,088,441.12	5.92
1	ARA	*	MEDIA	82,210,818.04	5.86
1	GISSA	A	MEDIA	70,068,405.70	4.99
1	GBM	O	BAJA	66,375,749.70	4.73
1	TMM	A	BAJA	37,236,637.25	2.65
1	GMXT	*	MEDIA	33,696,591.76	2.40
1				29,941,782.69	2.13
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO				1,352,870,534.95	96.36
OTROS VALORES				51,126,395.31	3.64
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES				1,403,996,930.26	100.00

CATEGORÍA
RVDIS

CALIFICACIÓN

VaR Promedio última semana
1.067%

Límite de VaR
2.800%

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

