

GBMfondos

GBMDIV2 GBM FONDO DE INVERSIONES DISCRECIONALES, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 31 OCTUBRE, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS						
1	KUO	B	BAJA	273,568	11,487,120.32	9.25
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
91	AGUA	17-2X	mxAA-	100,000	9,728,510.40	7.83
91	STORAGE	21-2V	AA-(mex)	94,349	9,468,650.15	7.62
91	DHIC	22B	AA+(mex)	80,000	5,745,831.68	4.63
91	METROCB	07	mxD	1,457,027	4,449,673.04	3.58
91	METROCB	02		1,496,522	3,352,209.28	2.70
CERTIFICADOS BURSÁTILES RESPALDADOS POR HIPOTECAS (BORHIS)						
97	MXMACCB	04U	CCC-.mx	368,782	25,296,853.54	20.37
97	MXMACCB	05U	CCC(mex)	279,120	3,943,632.89	3.18
CHEQUERAS BANCARIAS EN DÓLARES						
CHD	JPMOR	3128938		201,551	4,033,210.90	3.25
EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
D2SP	KUOBF33	270707	BB-	400	8,019,114.70	6.46
TRACKS EXTRANJEROS						
1I	MB3M	N	ALTA	2,318	25,960,788.70	20.90
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					111,485,595.60	89.76
REPORTO						
BI	CETES	251224	mxAAA	656,141	5,841,187.64	4.70
TOTAL REPORTO					5,841,187.64	4.70
OTROS VALORES				4,522,724	6,881,232.00	5.54
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					124,208,015.24	100.00

CATEGORÍA
RVDIS

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
0.223%

Límite de VaR
2.680%

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