

GBMfondos

NUMC FONDO ADMINISTRADO 5, 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	ICH	B	MEDIA	2,742,779,731.14	19.43
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	1,475,469,072.00	10.45
1	LACOMER	UBC	ALTA	1,058,650,761.63	7.50
1	GIGANTE	*	BAJA	1,030,771,616.00	7.30
1	DINE	B	BAJA	940,942,795.00	6.67
1	SIMEC	B	MEDIA	881,030,495.00	6.24
1	SORIANA	B	BAJA	785,535,174.48	5.57
1	CHDRAUI	B	ALTA	699,051,413.17	4.95
1	POSADAS	A	MINIMA	637,533,260.96	4.52
1	KUO	B	BAJA	535,047,791.33	3.79
1	PASA	B	MINIMA	533,990,409.80	3.78
1	KUO	A	MINIMA	427,185,121.60	3.03
1				845,389,668.08	5.99
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)					
1ISP	IB01	N	ALTA	1,102,184,206.39	7.81
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO				13,695,561,516.58	97.03
REPORTO					
LF	BONDESF	340323	mxAAA	292,470,801.86	2.07
TOTAL REPORTO				292,470,801.86	2.07
OTROS VALORES				127,304,096.32	0.90
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES				14,115,336,414.76	100.00

CATEGORÍA
RVDIS

CALIFICACIÓN

VaR Promedio última semana
0.801%

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 período 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