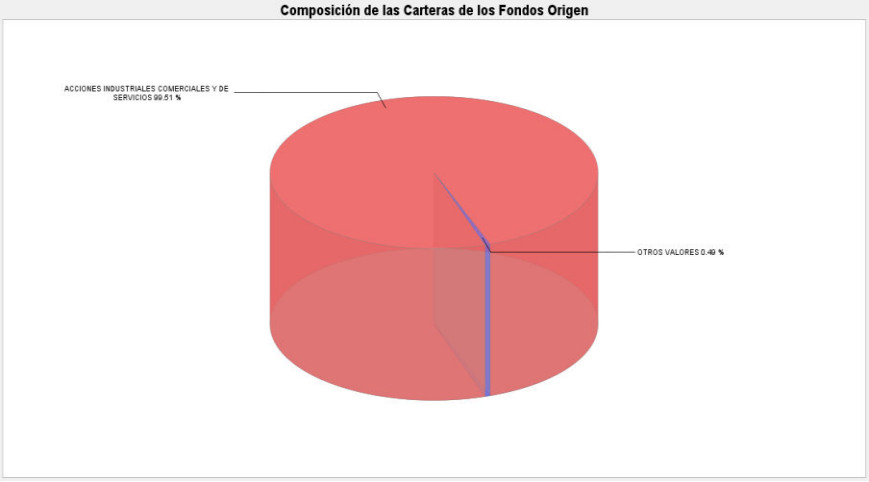
GBMfondos

GBM102 GBM 102, 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 DE FONDOS DE INVERSIÓN DE RENTA VARIABLE					
52	GBMV1	BFF	NA	185,868,569.12	15.04
ACCIONES DEL SISTEMA INTERNACIONAL DE COTIZACIONES (TIPO DE CAMBIO CIERRE)					
1ASP	PROK	N	ALTA	30,741,280.50	2.49
ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS					
1	FRAGUA	B	MEDIA	200,811,380.00	16.25
1	KUO	B	BAJA	144,085,248.00	11.66
1	BAFAR	B	BAJA	135,030,700.00	10.93
1	GMD	*	MINIMA	82,850,488.00	6.70
1	AGUILAS	CPO	MEDIA	68,198,680.95	5.52
1	CYDSASA	A	BAJA	65,824,432.80	5.33
1	PINFRA	L	MEDIA	51,991,842.00	4.21
1	AGUA	*	MEDIA	45,491,180.60	3.68
1	GISSA	A	MEDIA	45,466,742.30	3.68
1	GBM	O	BAJA	45,369,647.70	3.67
1	CULTIBA	B	BAJA	43,030,373.30	3.48
1				88,268,198.30	7.14
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO				1,233,028,763.57	99.78
OTROS VALORES				2,662,166.03	0.22
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES				1,235,690,929.60	100.00

CATEGORÍA	CALIFICACIÓN
RVDIS	

VaR Promedio última semana	Límite de VaR
0.945%	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