

GBMfondos

GBMNEAR GBM NEARSHORING, S.A. de C.V. Fondo de Inversión de Renta Variable CARTERA DE VALORES AL 14 NOVIEMBRE, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
ACCIONES DE BANCOS						
41	BBAJIO	O	ALTA	38,000	1,592,200.00	3.42
ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS						
1	PINFRA	*	ALTA	27,500	4,788,300.00	10.28
1	VESTA	*	ALTA	84,000	4,327,680.00	9.29
1	CEMEX	CPO	ALTA	340,000	3,726,400.00	8.00
1	GMEXICO	B	ALTA	30,000	3,071,100.00	6.60
1	ASUR	B	ALTA	5,600	3,011,848.00	6.47
1	GCC	*	ALTA	15,001	2,689,679.30	5.78
1	GFNORTE	O	ALTA	15,900	2,286,102.00	4.91
1	OMA	B	ALTA	13,000	2,182,440.00	4.69
1	GMXT	*	MEDIA	65,961	2,119,326.93	4.55
1	R	A	ALTA	16,000	1,954,560.00	4.20
1	ALPEK	A	MEDIA	120,000	1,629,600.00	3.50
1	NEMAK	A	MEDIA	877,000	1,534,750.00	3.30
1	TRAXION	A	ALTA	77,000	1,493,030.00	3.21
1	GISSA	A	MEDIA	83,000	1,423,450.00	3.06
1	AGUA	*	MEDIA	50,000	986,000.00	2.12
FIDEICOMISOS DE INFRAESTRUCTURA Y BIENES RAICES DE INVERSIÓN INMOBILIARIA						
CF	FMTY	14	ALTA	195,669	2,060,394.57	4.42
CF	FUNO	11	ALTA	75,000	1,681,500.00	3.61
CF	FIBRAPL	14	ALTA	18,000	1,155,960.00	2.48
CF	FNOVA	17	MEDIA	44,000	1,048,080.00	2.25
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					44,762,400.80	96.13
OTROS VALORES				95,585	1,802,440.18	3.87
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					46,564,840.98	100.00

CATEGORÍA
RVESFIBR

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.341%

Límite de VaR
3.450%

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

Lic. Julio Andres Maza Casas