

GBMfondos

GBMV2 GBM CAPITAL BURSATIL, S.A. DE C.V., F.I.R.V. CARTERA DE VALORES AL 14 NOVIEMBRE, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS						
1	KUO	B	BAJA	9,999,484	459,976,264.00	28.11
1	BAFAR	B	BAJA	2,728,421	272,842,100.00	16.68
1	CIDMEGA	*	MINIMA	3,647,917	123,992,698.83	7.58
1	GMD	*	MINIMA	8,003,461	89,638,763.20	5.48
1	GMEXICO	B	ALTA	814,179	83,347,504.23	5.09
1	MFRISCO	A-1	MEDIA	21,400,552	68,909,777.44	4.21
1	DINE	B	MINIMA	3,213,350	64,267,000.00	3.93
1	TMM	A	BAJA	10,371,667	53,102,935.04	3.25
1	GIGANTE	*	BAJA	1,808,662	50,642,536.00	3.10
1	NEMAK	A	MEDIA	20,302,781	35,529,866.75	2.17
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS				45,208,369	155,272,873.71	9.49
FIDEICOMISOS DE INFRAESTRUCTURA Y BIENES RAICES DE INVERSIÓN INMOBILIARIA						
CF	FNOVA	17	MEDIA	5,684,423	135,402,955.86	8.28
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					1,592,925,275.06	97.36
OTROS VALORES				4,801,827	43,150,899.00	2.64
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					1,636,076,174.06	100.00

CATEGORÍA RVDIS

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.187%

Límite de VaR
3.960%

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

Lic. Julio Andres Maza Casas