

GBMfondos

GBMAGR GBM FONDO DE INVERSION TOTAL, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 31 OCTUBRE, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Titulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS						
1	LACOMER	UBC	ALTA	31,729,973	1,148,307,722.87	12.37
1	KUO	B	BAJA	26,315,135	1,104,972,518.65	11.90
1	POSADAS	A	MINIMA	32,058,704	874,882,032.16	9.42
1	LAMOSA	*	MEDIA	6,486,339	771,874,341.00	8.31
1	FRAGUA	B	MEDIA	796,906	701,277,280.00	7.55
1	SORIANA	B	BAJA	24,498,259	695,505,573.01	7.49
1	HERDEZ	*	MEDIA	10,074,503	527,299,487.02	5.68
1	GIGANTE	*	BAJA	18,260,143	511,284,004.00	5.51
1	GBM	O	BAJA	31,879,413	372,989,132.10	4.02
1	SIMEC	B	MEDIA	1,525,268	282,174,580.00	3.04
1	ICH	B	MEDIA	1,497,145	274,741,078.95	2.96
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS				46,148,912	1,030,291,028.29	11.09
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)						
1ISP	IB01	N	ALTA	327,988	741,919,396.22	7.99
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					9,037,518,174.27	97.32
REPORTO						
LF	BONDEF	340323	mxAAA	2,517,861	249,204,595.47	2.68
TOTAL REPORTO					249,204,595.47	2.68
OTROS VALORES				27,984,568	27.98	0.00
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					9,286,722,797.72	100.00

CATEGORÍA
RVESACC

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
0.575%

Limite de VaR
3.250%

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