

gbmfondos

GBMNEAR GBM NEARSHORING, S.A. de C.V. Fondo de Inversión de Renta Variable
CARTERA DE VALORES AL 31 OCTUBRE, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS						
1	PINFRA	*	ALTA	26,500	4,625,045.00	9.92
1	VESTA	*	ALTA	84,000	4,392,360.00	9.42
1	CEMEX	CPO	ALTA	353,000	3,720,620.00	7.98
1	GCC	*	ALTA	18,500	3,027,340.00	6.49
1	ASUR	B	ALTA	5,300	2,836,401.00	6.08
1	GFNORTE	O	ALTA	17,000	2,368,610.00	5.08
1	GMEXICO	B	ALTA	21,000	2,198,490.00	4.72
1	OMA	B	ALTA	12,700	2,128,647.00	4.57
1	GMXT	*	MEDIA	68,000	2,050,880.00	4.40
1	R	A	ALTA	16,000	2,033,120.00	4.36
1	NEMAK	A	MEDIA	843,000	1,778,730.00	3.82
1	TRAXION	A	ALTA	65,877	1,434,801.06	3.08
1	ALPEK	A	MEDIA	109,197	1,418,469.03	3.04
1	GISSA	A	MEDIA	75,000	1,285,500.00	2.76
FIDEICOMISOS DE INFRAESTRUCTURA Y BIENES RAICES DE INVERSIÓN INMOBILIARIA						
CF	FMTY	14	ALTA	156,409	1,618,833.15	3.47
CF	FUNO	11	ALTA	70,000	1,612,800.00	3.46
CF	FIBRAPL	14	ALTA	18,000	1,205,460.00	2.59
OTROS TIPO DE VALOR CF - FIDEICOMISOS DE INFRAESTRUCTURA Y BIENES RAICES DE INVERSIÓN INMOBILIARIA				46,777	1,269,654.24	2.72
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					41,005,760.48	87.97
PRESTAMO DE VALORES						
CF	FMTY	14	ALTA	118,591	1,227,416.85	2.63
OTROS VALORES				126,668	4,380,237.16	9.40
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					46,613,414.49	100.00
TOTAL PRESTAMO DE VALORES					1,227,416.85	2.63

CATEGORÍA
RVESFIBR

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
1.339%

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