

GBMfondos

GBMV2 GBM CAPITAL BURSATIL, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
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	KUO	B	BAJA	9,999,484	419,878,333.16	25.79
1	BAFAR	B	BAJA	2,728,421	264,656,837.00	16.26
1	CIDMEGA	*	MINIMA	3,647,917	123,992,698.83	7.62
1	GMD	*	MINIMA	8,003,461	89,638,763.20	5.51
1	MFRISCO	A-1	BAJA	21,400,552	83,462,152.80	5.13
1	DINE	B	BAJA	3,213,350	76,317,062.50	4.69
1	TMM	A	BAJA	10,371,667	53,414,085.05	3.28
1	GIGANTE	*	BAJA	1,808,662	50,642,536.00	3.11
1	NEMAK	A	MEDIA	20,302,781	42,838,867.91	2.63
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS				45,061,298	166,859,222.17	10.25
FIDEICOMISOS DE INFRAESTRUCTURA Y BIENES RAICES DE INVERSIÓN INMOBILIARIA						
CF	FNOVA	17	MEDIA	4,615,000	109,837,000.00	6.75
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					1,481,537,558.62	91.00
PRESTAMO DE VALORES						
1	GMEXICO	B	ALTA	600,000	62,814,000.00	3.86
OTROS VALORES					5,154,097	5.14
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					1,628,076,551.48	100.00
TOTAL PRESTAMO DE VALORES					62,814,000.00	3.86

	CATEGORÍA	
	RVDIS	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
	1.143%	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 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