

GBMfondos

GBMCRE GBM FONDO DE CRECIMIENTO, S.A. DE C.V. F.I.R.V. CARTERA DE VALORES AL 19 DICIEMBRE, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS						
1	KUO	B	BAJA	3,255,428	143,238,832.00	25.77
1	CYDSASA	A	BAJA	5,044,691	84,498,574.25	15.20
1	CULTIBA	B	BAJA	7,735,824	79,678,987.20	14.33
1	PASA	B	MINIMA	1,925,591	73,172,458.00	13.16
1	FRAGUA	B	MEDIA	118,816	66,932,617.28	12.04
1	GMD	*	MINIMA	3,588,110	37,639,273.90	6.77
1	GISSA	A	MEDIA	1,466,016	24,922,272.00	4.48
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS				3,609,341		8.08
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					555,012,932.27	99.85
OTROS VALORES				107,789	829,103.17	0.15
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					555,842,035.44	100.00

CATEGORÍA RVDIS		
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Limite de VaR
	0.933%	2.740%

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