

GBMfondos

GBMCRE GBM FONDO DE CRECIMIENTO, S.A. DE C.V. F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 05 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	133,472,548.00	23.71
1	CYDSASA	A	BAJA	5,044,691	87,071,366.66	15.47
1	CULTIBA	B	BAJA	7,735,800	81,225,900.00	14.43
1	FRAGUA	B	MEDIA	118,816	75,278,253.12	13.37
1	PASA	B	MINIMA	1,925,591	73,172,458.00	13.00
1	GMD	*	MINIMA	3,588,110	39,397,447.80	7.00
1	GISSA	A	MEDIA	1,466,016	25,948,483.20	4.61
1	WALMEX	*	ALTA	232,000	13,228,640.00	2.35
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS				3,686,940	32,913,902.65	5.85
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					561,708,999.43	99.77
OTROS VALORES				56,766	1,292,871.61	0.23
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					563,001,871.04	100.00

CATEGORÍA
RVDIS

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
0.916%

Límite de VaR
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