

gbmfondos

GBM104 GBM 104, S.A. DE C.V., F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 08 MAYO, 2025

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Valor Razonable	%
DIRECTO					
ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS					
1	LACOMER	UBC	ALTA	1,526,352,410.52	17.06
1	SORIANA	B	BAJA	864,231,217.92	9.66
1	KUO	B	BAJA	769,301,094.10	8.60
1	POSADAS	A	MEDIA	692,563,850.00	7.74
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	638,038,779.84	7.13
1	SIMEC	B	MEDIA	465,153,932.69	5.20
1	LAMOSA	*	BAJA	463,211,248.50	5.18
1	ICH	B	MEDIA	365,252,455.17	4.08
1	GBM	O	BAJA	356,246,500.70	3.98
1	GIGANTE	*	BAJA	269,055,016.40	3.01
1	HERDEZ	*	MEDIA	263,968,483.52	2.95
1	GENTERA	*	ALTA	246,241,388.68	2.75
1				888,561,907.07	9.93
TRACKS EXTRANJEROS (TIPO DE CAMBIO CIERRE)					
11SP	IB01	N	ALTA	854,373,006.91	9.55
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO				8,662,551,292.02	96.83
OTROS VALORES				283,208,765.91	3.17
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES				8,945,760,057.93	100.00

CATEGORÍA RVDIS	CALIFICACIÓN
VaR Promedio última semana 0.675%	Límite de VaR 3.000%

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

