

GBMfondos

GBMCRE GBM FONDO DE CRECIMIENTO, S.A. DE C.V. F.I.R.V. CARTERA DE VALORES AL 09 MAYO, 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	145,192,088.80	22.18
1	CYDSASA	A	MEDIA	5,051,904	97,097,594.88	14.83
1	FRAGUA	B	MEDIA	120,926	96,740,800.00	14.78
1	CULTIBA	B	MEDIA	7,837,091	83,856,873.70	12.81
1	PASA	B	BAJA	1,925,591	73,172,458.00	11.18
1	GMD	*	MINIMA	3,588,110	44,492,564.00	6.80
1	GISSA	A	MEDIA	1,537,602	33,365,963.40	5.10
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS				4,367,309	75,439,226.93	11.52
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					649,357,569.71	99.20
OTROS VALORES				65,003	5,254,234.40	0.80
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					654,611,804.11	100.00

	CATEGORÍA	
	RVDIS	
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Límite de VaR
	0.853%	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