

GBMfondos

GBMCRE GBM FONDO DE CRECIMIENTO, S.A. DE C.V. F.I.R.V. CARTERA DE VALORES AL 27 MARZO, 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	138,355,690.00	21.38
1	CYDSASA	A	BAJA	5,051,904	94,695,505.46	14.63
1	CULTIBA	B	BAJA	7,835,713	89,875,628.11	13.89
1	FRAGUA	B	MEDIA	120,926	81,106,277.46	12.53
1	PASA	B	BAJA	1,925,591	73,172,458.00	11.31
1	GMD	*	MINIMA	3,588,110	49,516,707.38	7.65
1	GISSA	A	BAJA	1,537,602	36,287,407.20	5.61
1	CEMEX	CPO	ALTA	1,106,000	16,225,020.00	2.51
1	ASUR	B	ALTA	29,000	15,206,440.00	2.35
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS				3,291,127	46,193,965.12	7.14
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					640,635,098.73	98.98
OTROS VALORES				78,869	6,575,910.75	1.02
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					647,211,009.48	100.00

CATEGORÍA RVDIS

CALIFICACIÓN

VaR Promedio
0.864%

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

Lic. Julio Andres Maza Casas