

GBMfondos

GBMCRE GBM FONDO DE CRECIMIENTO, S.A. DE C.V. F.I.R.V.
CARTERA DE VALORES AL 23 NOVIEMBRE, 2023

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS						
1	KUO	B	BAJA	3,302,909	132,017,272.73	21.66
1	CYDSASA	A	BAJA	5,526,904	97,273,510.40	15.96
1	CULTIBA	B	BAJA	8,836,319	91,986,080.79	15.09
1	FRAGUA	B	MEDIA	132,926	62,342,294.00	10.23
1	PASA	B	BAJA	1,925,591	57,575,170.90	9.44
1	GMD	*	MINIMA	3,588,110	51,263,363.45	8.41
1	GISSA	A	MEDIA	1,574,357	42,208,511.17	6.92
1	CEMEX	CPO	ALTA	1,263,000	14,953,920.00	2.45
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS				3,152,864	57,317,092.03	9.40
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					606,937,215.47	99.56
OTROS VALORES				82,950	2,687,654.90	0.44
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					609,624,870.37	100.00

CATEGORÍA		
RVDIS		
CALIFICACIÓN	VaR Promedio	Limite de VaR
	0.806%	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