

# GBMfondos

## GBMCRE GBM FONDO DE CRECIMIENTO, S.A. DE C.V. F.I.R.V. CARTERA DE VALORES AL 30 SEPTIEMBRE, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
<b>DIRECTO</b>						
<b>ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS</b>						
1	KUO	B	BAJA	3,255,428	136,727,976.00	22.76
1	FRAGUA	B	MEDIA	118,816	106,916,577.60	17.80
1	CULTIBA	B	MEDIA	7,845,652	78,456,520.00	13.06
1	CYDSASA	A	MEDIA	5,051,904	78,051,916.80	12.99
1	PASA	B	MINIMA	1,925,591	73,172,458.00	12.18
1	GMD	*	MINIMA	3,588,110	42,267,935.80	7.04
1	GISSA	A	MEDIA	1,510,574	29,335,347.08	4.88
1	WALMEX	*	ALTA	207,500	12,277,775.00	2.04
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS				3,919,341	41,801,272.52	6.96
<b>TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO</b>					<b>599,007,778.80</b>	<b>99.70</b>
<b>OTROS VALORES</b>				56,269	<b>1,810,803.72</b>	<b>0.30</b>
<b>TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES</b>					<b>600,818,582.52</b>	<b>100.00</b>

	<b>CATEGORÍA</b>	
	RVDIS	
<b>CALIFICACIÓN</b>	<b>VaR Promedio</b>	<b>Límite de VaR</b>
	0.898%	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